

Swiss Life iFunds (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

für qualifizierte Anleger

Mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term
(CHF hedged)

Geprüfter Jahresbericht per 30. September 2020

Geprüfter Jahresbericht per 30. September 2020

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	3	
Mitteilung an die Anleger	5	
Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft zu den Jahresrechnungen	10	
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)	11 I-A1/	CH0023989467
Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)	17 I-A1/	CH0023989509
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)	45 I-A1/ I-A2/	CH0023989582 CH0219870471
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	55 I-A1/ I-A2/ I-A3/	CH0023989624 CH0324001301 CH0384999642
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)	67 I-A1/ I-A2/	CH0114218610 CH0219870703
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)	83 I-A1/ I-A2/	CH0023989764 CH0324001053
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)	93 I-A1/	CH0108009199
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)	99 I-A1/ I-A2/ I-A2 Cap/	CH0219870430 CH0219870455 CH0407409843
Anhang zu Ergänzende Angaben	114	

Verkaufsrestriktionen

Anteile dieser Teilvermögen des Umbrella-Fonds dürfen innerhalb der USA weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Anlegern, die US Persons sind, dürfen keine Anteile dieser Teilvermögen angeboten, verkauft oder ausgeliefert werden. Eine US Person ist eine Person, die:

- (i) eine United States Person im Sinne von Paragraf 7701(a)(30) des US Internal Revenue Code von 1986 in der geltenden Fassung sowie der in dessen Rahmen erlassenen Treasury Regulations ist;
- (ii) eine US Person im Sinne von Regulation S des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (17 CFR § 230.902(k)) ist;
- (iii) keine Non-United States Person im Sinne von Rule 4.7 der US Commodity Futures Trading Commission Regulations (17 CFR § 4.7(a)(1)(iv)) ist;
- (iv) sich im Sinne von Rule 202(a)(30)-1 des US Investment Advisers Act von 1940 in der geltenden Fassung in den Vereinigten Staaten aufhält; oder
- (v) ein Trust, eine Rechtseinheit oder andere Struktur ist, die zu dem Zweck gegründet wurde, dass US Persons in diesen Umbrella-Fonds investieren können.

Internetadresse

www.swisslife-am.com

Organisation

Fondsleitung

Swiss Life Asset Management AG
General-Guisan-Quai 40
8002 Zürich

Verwaltungsrat

Stefan Mächler, Präsident
Group CIO und Mitglied der Konzernleitung der Swiss Life Gruppe

Hermann Inglin
CFO der Swiss Life Investment Management Holding AG

Lorenzo Kyburz
Head Legal & Compliance der Swiss Life Investment Management Holding AG

Dr. Lorenz Schumann
Mitglied des Verwaltungsrats der swissQuant Group AG des Ingenieurbüro Götsch AG und der SIM Global Advantage AG, Inhaber der Schumann Strategic Advisory

Markus Walter Honauer
Mitglied des Verwaltungsrats der VERIT Immobilien AG, der Urban Assets Zug AG, der pom + Consulting AG und der pom+Group AG, Mitglied des Stiftungsrats der HIG Immobilien Anlagestiftung sowie Mitglied des Verwaltungsrats der Tech Cluster Zug AG

Geschäftsleitung

Geschäftsleiter
Robin van Berkel

Stellvertretender Geschäftsleiter
Daniel Berner

Mitglieder der Geschäftsleitung
Michael Klose
Renato Piffaretti
Jan Grunow
Marius Würigler

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG
Birchstrasse 160, 8050 Zürich

Delegation der Anlageentscheide

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland
Small & Mid Cap (CHF)
Privatbank von Graffenried AG, Bern

Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)
UBS Asset Management, ein Unternehmensbereich von UBS AG, Basel und Zürich

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)
Pictet Asset Management S.A., Genf

Delegation der Fondsadministration

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenplatz 6, 4052 Basel, delegiert: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Weiterdelegation

Die Administration des Anlagefonds, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Switzerland AG, Basel, weiterdelegiert. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen UBS Fund Management (Switzerland) AG und Northern Trust Switzerland AG abgeschlossenen Vertrag geregelt.

Delegation weiterer Teilaufgaben

Die interne Revision ist an das Konzernrevisorat der Swiss Life Gruppe delegiert. Weitere Teilaufgaben in den Bereichen Legal & Compliance, Business Controlling und Buchhaltung der Fondsleitung sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG delegiert. IT-Infrastrukturdienstleistungen, Applikationsentwicklung und -betrieb, Personal-, Rechts- und Steuerdienstleistungen sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG und an die Swiss Life AG delegiert. Die Delegierten zeichnen sich aus durch ihre langjährige Erfahrung in den delegierten Bereichen. Die genaue Ausführung der Aufträge regeln zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und den Beauftragten abgeschlossene Verträge.

Zahlstellen

UBS Switzerland AG, Zürich
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Mitteilung an die Anleger

Änderungen des Fondsvertrages

Der Fondsvertrag des «Swiss Life iFunds (CH)» wurde zweimal geändert. Die erste Publikation wurde am 31. Oktober 2019 auf Swiss Fund Data veröffentlicht. Die Änderungen wurden von der FINMA am 6. Dezember 2019 genehmigt. Der angepasste Fondsvertrag ist am 10. Dezember 2019 in Kraft getreten. Die zweite Publikation wurde am 20. Mai 2020 auf Swiss Fund Data veröffentlicht. Die Änderungen wurden von der FINMA am 26. Juni 2020 genehmigt. Der angepasste Fondsvertrag ist am 1. Juli 2020 in Kraft getreten. Anschliessend finden Sie die erschienenen Mitteilungen.

Der Fondsvertrag ist bei der Fondsleitung sowie am Hauptsitz und an den Niederlassungen der Depotbank kostenlos erhältlich.

Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) vom 23. Juni 2006, Art. 27 Abs. 2 KAG

Swiss Life iFunds (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen» mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Swiss Life Asset Management AG, Zürich, als Fondsleitung, und UBS Switzerland AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, gemäss Art. 27 des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG) die nachfolgend erwähnten Änderungen im Fondsvertrag des oben aufgeführten Umbrella-Fonds vorzunehmen. Die vorgesehenen Änderungen betreffen die Einführung neuer thesaurierender Anteilsklassen sowie die Bestimmungen über die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen an schweizerischen Feiertagen.

Die Anleger des oben erwähnten Umbrella-Fonds werden hiermit über die nachfolgenden Änderungen des Fondsvertrages informiert:

§ 6 Anteile und Anteilsklassen

- In § 6 Ziff. 4 wird neu die Anteilsklasse I-A1 Cap eingefügt. Der Wortlaut ist neu:
«Zurzeit bestehen für jedes Teilvermögen grundsätzlich zwei Anteilsklassen I-A1 und I-A2. Der Besondere Teil kann für die einzelnen Teilvermögen festlegen, dass zusätzlich die Anteilsklassen I-A1 Cap bzw. I-A2 Cap bestehen. Für das Teilvermögen Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged) besteht eine weitere Anteilsklasse I-A3:»
- Im Zusammenhang mit der neuen Anteilsklasse I-A1 Cap wird § 6 Ziff. 4 (1. Spiegelstrich) ergänzt:
-»Anteilsklassen I-A1 und I-A1 Cap: Anteile dieser Anteilsklassen stehen nur qualifizierten Anlegern gemäss § 5 Ziff. 1 des Fondsvertrages offen, welche mit der Swiss Life Asset Management AG oder mit einer anderen zur Swiss Life Gruppe gehörenden Unternehmung einen Vermögensverwaltungsvertrag oder einen anderen entgeltlichen Finanzdienstleistungsvertrag abgeschlossen haben.»
- In § 6 Ziff. 10 wird die Anteilsklasse I-A1 Cap ergänzt. Satz 1 lautet neu: «Die Fondsleitung ist verpflichtet, Anleger in den Anteilsklassen I-A1, I-A1 Cap, I-A2, I-A2 Cap und I-A3, welche die Voraussetzungen gemäss § 5 Ziff. 1 nicht bzw. nicht mehr erfüllen, aufzufordern, ihre Anteile innert 30 Kalendertagen im Sinne von § 19 zurückzugeben oder an eine andere Person zu übertragen, die die genannten Voraussetzungen erfüllt.»

§ 19 Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

In § 19 Ziff. 1 lit. b) wird folgender Absatz ba) zu Ausgaben und Rücknahmen von Anteilen an schweizerischen Feiertagen eingefügt: «Keine Ausgaben oder Rücknahmen von Anteilen finden statt: ba) an schweizerischen Feiertagen (Ostern, Pfingsten, Weihnachten (inkl. 24. Dezember), Neujahr (inkl. 31. Dezember), Nationalfeiertag etc.);»

§ 32A, § 32B § 32G Anteilsklassen

Der erste Absatz wird um die Anteilsklasse I-A1 Cap ergänzt. Er lautet neu: «Das Teilvermögen verfügt zurzeit über drei Anteilsklassen I-A1, I-A1 Cap und I-A2, deren Referenzwährung der Schweizer Franken ist. Die Erträge der Anteilsklassen I-A1 und I-A2 werden ausgeschüttet. Die Erträge der Anteilsklasse I-A1 Cap werden thesauriert.»

§ 37A, § 37B, 37G, 37H Verwaltungs- und Depotbankkommission

In Abs. 1 lit. a) wird die Anteilsklasse I-A1 Cap ergänzt, für die dieselben Bedingungen gelten wie für die bestehende Anteilsklasse I-A1.

§ 39A, § 39B, § 39 G Ausschüttungen

In Abs. 1 wird folgender letzter Abschnitt eingefügt: «Der Nettoertrag der Anteilsklasse I-A1 Cap wird jährlich spätestens innerhalb von vier Monaten nach Abschluss des Rechnungsjahres dem Vermögen des Teilvermögens zur Wiederanlage hinzugefügt. Die Fondsleitung kann auch Zwischenthesaurierungen des Ertrages beschliessen. Vorbehalten bleiben allfällige auf der Wiederanlage erhobene Steuern und Abgaben.»

§ 32C, § 32E, § 32F Anteilsklassen

Der erste Absatz wird um die Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap ergänzt. Er lautet neu: «Das Teilvermögen verfügt zurzeit über vier Anteilsklassen I-A1, I-A1 Cap, I-A2 und I-A2 Cap, deren Referenzwährung der Schweizer Franken ist. Die Erträge der Anteilsklassen I-A1 und I-A2 werden ausgeschüttet. Die Erträge der Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap werden thesauriert.»

§ 37C, § 37D, § 37E, 37F Verwaltungs- und Depotbankkommission

In Abs. 1 lit. a) wird die Anteilsklasse I-A1 Cap ergänzt, für die dieselben Bedingungen gelten wie für die bestehende Anteilsklasse I-A1. In Abs. 1 lit. b) wird die Anteilsklasse I-A2 Cap ergänzt, für die dieselben Bedingungen gelten wie für die bestehende Anteilsklasse I-A2.

§ 39C, § 39D, § 39E, § 39F Ausschüttungen

In Abs. 1 wird folgender letzter Abschnitt eingefügt: «Der Nettoertrag der Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap wird jährlich spätestens innerhalb von vier Monaten nach Abschluss des Rechnungsjahres dem Vermögen des Teilvermögens zur Wiederanlage hinzugefügt. Die Fondsleitung kann auch Zwischenthesaurierungen des Ertrages beschliessen. Vorbehalten bleiben allfällige auf der Wiederanlage erhobene Steuern und Abgaben.»

§ 32D Anteilsklassen

Der erste Absatz wird um die Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap ergänzt. Er lautet neu: «Das Teilvermögen verfügt zur Zeit über fünf Anteilsklassen I-A1, I-A1 Cap, I-A2, I-A2 Cap und I-A3, deren Referenzwährung der Schweizer Franken ist. Die Erträge der Anteilsklassen I-A1, I-A2 und I-A3 werden ausgeschüttet. Die Erträge der Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap werden thesauriert.»

§ 32H Anteilsklassen

Der erste Absatz wird um die Anteilsklasse I-A1 Cap ergänzt. Er lautet neu: «Das Teilvermögen verfügt zurzeit über vier Anteilsklassen I-A1, I-A1 Cap, I-A2 und I-A2 Cap, deren Referenzwährung der Schweizer Franken ist.

Die Erträge der Anteilsklassen I-A1 und I-A2 werden ausgeschüttet. Die Erträge der Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap werden thesauriert.»

§ 39H Ausschüttungen

Die Anteilsklasse I-A1 Cap wird im letzten Absatz ergänzt, der neu lautet: «Der Nettoertrag der Anteilsklassen I-A1 Cap und I-A2 Cap wird jährlich spätestens innerhalb von vier Monaten nach Abschluss des Rechnungsjahres dem Vermögen des Teilvermögens zur Wiederanlage hinzugefügt. Die Fondsleitung kann auch Zwischenthesaurierungen des Ertrages beschliessen. Vorbehalten bleiben allfällige auf der Wiederanlage erhobene Steuern und Abgaben.»

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht lediglich auf die umschriebenen Änderungen in § 6 und §§ 32A-H erstreckt.

Dieser Publikationstext wird am 31. Oktober 2019 auf der elektronischen Plattform der Swiss Fund Data AG (www.swissfunddata.ch) veröffentlicht.

Anleger, welche gegen die vorgesehene Änderung des § 19 des Fondsvertrags Einwendung erheben wollen, müssen dies innert 30 Tagen seit der Publikation gegenüber der Aufsichtsbehörde (Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern) geltend machen (Art. 27 Abs. 3 KAG). Den bestehenden Anlegern steht zudem das Recht zu, die Auszahlung ihrer Anteile zu verlangen.

Gegen die Auflegung einer Anteilsklasse ist das Einwendungsrecht des Anlegers gemäss Art. 40 Abs. 3 KKV i.V.m. Art. 27 KAG und gemäss § 6 Ziff. 2 i.V.m. § 29 Fondsvertrag ausgeschlossen.

Die Vertragsänderungen im Wortlaut, der Fondsvertrag sowie die Jahresberichte können bei der Fondsleitung, der Depotbank und jedem Vertriebsträger kostenlos bezogen werden.

Zürich, den 31. Oktober 2019

Die Fondsleitung
Swiss Life Asset Management AG
General-Guisan-Quai 40
8002 Zürich

Die Depotbank
UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Swiss Life iFunds (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen» mit
den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Swiss Life Asset Management AG, Zürich, als Fondsleitung, und UBS Switzerland AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, gemäss Art. 27 des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG) die nachfolgend erwähnten Änderungen im Fondsvertrag des oben aufgeführten Umbrella-Fonds vorzunehmen. Die vorgesehenen Änderungen betreffen insbesondere die Berücksichtigung von Derivaten, die zu Absicherungszwecken und zur Steuerung von Zinsänderungs- und Kreditrisiken eingesetzt werden, bei der Berechnung der Minimal- und Maximalbeschränkungen der Anlagepolitik.

Die Anleger des oben erwähnten Umbrella-Fonds werden hiermit über die nachfolgenden Änderungen des Fondsvertrages informiert:

§ 1 Bezeichnung, nicht anwendbare Bestimmungen des KAG, Firma und Sitz von Fondsleitung, Depotbank und Vermögensverwalter

Die Vermögensverwaltung des Teilvermögens Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF) ist neu an die UBS Asset Management Switzerland AG übertragen (bisher: UBS Asset Management, ein Unternehmensbereich der UBS AG). Die Änderung bezweckt den formellen Nachvollzug einer internen Reorganisation bei der UBS. Dies wird in Ziff. 6 lit. b) korrigiert.

§ 8 Anlagepolitik

In § 8 wird folgende Ziffer 10 eingefügt:

«Derivate, wenn (i) ihnen als Basiswerte Effekten, Derivate, Anteile an kollektiven Kapitalanlagen, Geldmarktinstrumente, Finanzindizes, Zinssätze, Wechselkurse, Kredite oder Währungen zugrunde liegen, und (ii) die zu Grunde liegenden Basiswerte gemäss

Fondsvertrag als Anlagen zulässig sind. Derivate sind entweder an einer Börse oder an einem andern geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt oder OTC gehandelt; OTC-Geschäfte sind nur zulässig, wenn (i) die Gegenpartei ein beaufsichtigter, auf dieses Geschäft spezialisierter Finanzintermediär ist, und (ii) die OTC-Derivate täglich handelbar sind oder eine Rückgabe an den Emittenten jederzeit möglich ist. Zudem sind sie zuverlässig und nachvollziehbar bewertbar. Derivate können gemäss § 13 eingesetzt werden.»

Ziff. 10 wird entsprechend zu Ziff. 11.

§ 16 Risikoverteilung

In § 16 wird die Terminologie korrigiert, sodass es statt Referenzindex neu Benchmark heisst. Hierbei handelt es sich um eine rein sprachliche Anpassung. Der neue Wortlaut von Ziffer 4 und 6 ist:

4. Bei Teilvermögen, welche einen Index (Benchmark) abbilden, gelten in Abweichung von Ziff. 3 folgende Bestimmungen:
 - a) Der zulässige Anteil der Beteiligungswertpapiere und -wertrechte eines Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens richtet sich grundsätzlich nach dessen Anteil an der entsprechenden Benchmark. Dabei ist gemäss den Bestimmungen von lit. b und c unten eine beschränkte Über- oder Untergewichtung zulässig. Vorbehalten bleiben die Bestimmungen des Besonderen Teils.
 - b) Bei Teilvermögen, welche die Benchmark nur teilweise abbilden, darf der Anteil der Beteiligungswertpapiere und -wertrechte eines Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens, dessen Gewichtung in der Benchmark mindestens 1% beträgt, 120% von dessen prozentualer Gewichtung im jeweiligen Index nicht überschreiten bzw. 80% nicht unterschreiten. Vorbehalten bleiben die Bestimmungen von lit. c unten.
 - c) Der Anteil der Beteiligungswertpapiere und -wertrechte eines Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens, dessen Gewichtung in der Benchmark weniger als 1% beträgt, darf bei Teilvermögen, welche die Benchmark nur teilweise abbilden, die prozentuale Gewichtung in der jeweiligen Benchmark um bis zu 0.20 Prozentpunkte über- bzw. unterschreiten.
 - d) Die Bestimmungen von litt. a bis c finden sinngemäss auch auf Beteiligungswertpapiere und -wertrechte von Emittenten Anwendung, die noch nicht in der Benchmark enthalten sind, bei denen aufgrund der für den Index geltenden Aufnahmekriterien jedoch eine Aufnahme mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist bzw. die noch in der Benchmark enthalten sind, bei denen jedoch ein Ausschluss aus der Benchmark mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist. Bei der Berechnung wird dabei auf die zu erwartende Benchmarkgewichtung abgestellt.

Soweit die Benchmarks auch Anteile bzw. Aktien kollektiver Kapitalanlagen umfassen, findet der Begriff der Beteiligungswertpapiere und –wertrechte in Verbindung mit dieser Ziff. 4 sinngemäss auf solche Anteile Anwendung.»

Hierdurch kann eine Konzentration des Vermögens eines Teilvermögens auf wenige, in der Benchmark enthaltene Titel entstehen, was zu einem Gesamtrisiko des jeweiligen Teilvermögens führen kann, das über dem Risiko der Benchmark (Marktrisiko) liegt.

6. Die in Ziff. 3 oben erwähnte Grenze von 10% ist auf 30% angehoben, wenn es sich um direkte oder indirekte Anlagen gemäss § 8 Ziff. 3 lit. a von Gesellschaften handelt, deren prozentuale Gewichtung in einem führenden Sektor-, Regionen- oder Länderindex 8% übersteigt. Dabei darf der Anteil am Nettovermögen des Teilvermögens aller Aktien und anderen Wertpapiere des Emittenten dessen prozentuale Gewichtung in der Benchmark nicht um mehr als 50% überschreiten. Diese Ausnahme gilt nur für Teilvermögen, die hauptsächlich in der/dem der Benchmark zugrunde liegenden Sektor, Region bzw. Land investieren. Vorbehalten bleiben die Ausnahmen gemäss Ziff. 4.»

§ 21 Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen

Ziffer 4 von § 21 wird korrigiert. Statt auf Rückvergütungen wird neu auf Retrozessionen und Rabatte Bezug genommen:

«Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 3% betragen.»

§ 33B Anlageziel und Anlagepolitik

In Ziffer 2 wird die Terminologie korrigiert, sodass es statt Referenzindex neu Benchmark heisst. Es handelt sich um eine rein sprachliche Anpassung. Die Anlagepolitik des Teilvermögens bleibt unverändert.

- a) Das Vermögen des Teilvermögens wird (neben den flüssigen Mitteln) in direkte und indirekte Anlagen in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte gemäss § 8 Ziff. 3 lit. a des Allgemeinen Teils angelegt, die in der Benchmark enthalten sind. Dabei kann die Fondsleitung statt in sämtliche Titel der Benchmark zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimised Sampling).
- b) Das Vermögen des Teilvermögens kann auch in Beteiligungswertpapiere und -rechte von Unternehmen angelegt werden, die in der Benchmark nicht enthalten sind, von denen jedoch von ihrer Börsenkapitalisierung und Marktgängigkeit her und aufgrund der für die Benchmark vorgesehenen Aufnahme Kriterien mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist, dass sie bei der nächsten Anpassung in die Benchmark aufgenommen werden. Das Vermögen kann auch Beteiligungswertpapiere und -rechte

von Unternehmen enthalten, die in der Benchmark nicht mehr enthalten sind, sofern diese Positionen innert angemessener Frist veräussert werden oder im Interesse der Anleger aufgrund von laufenden Kapitalmassnahmen weiterhin gehalten werden.

- c) Das Vermögen des Teilvermögens kann in Derivate (einschliesslich Warrants) auf die Benchmark und die oben erwähnten Anlagen sowie auf der Benchmark bzw. Teilsegmenten der Benchmark nahestehende Indizes angelegt werden, die eine hohe Korrelation zur Benchmark bzw. zum entsprechenden Teilsegment der Benchmark aufweisen.
- d) Das Vermögen des Teilvermögens kann in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen angelegt werden, die auf die Benchmark oder Teilsegmente der Benchmark lauten sowie auf der Benchmark bzw. Teilsegmenten der Benchmark nahestehende Indices, die eine hohe Korrelation zur Benchmark bzw. zum entsprechenden Teilsegment der Benchmark aufweisen.»

§ 33C Anlageziel und Anlagepolitik

Es wird folgende Ziffer 6 ergänzt:

«Derivate, die zu Absicherungszwecken und zur Steuerung von Zinsänderungs- und Kreditrisiken eingesetzt werden, bleiben bei den in Ziff. 2 und Ziff. 3 genannten Minimal- und Maximalbeschränkungen unberücksichtigt.»

§ 33D Anlageziel und Anlagepolitik

Es wird folgende Ziffer 7 ergänzt:

«Derivate, die zu Absicherungszwecken und zur Steuerung von Zinsänderungs- und Kreditrisiken eingesetzt werden, bleiben bei den in Ziff. 2 und Ziff. 3 genannten Minimal- und Maximalbeschränkungen unberücksichtigt.»

§ 33E Anlageziel und Anlagepolitik

Es wird folgende Ziffer 7 ergänzt:

«Derivate, die zu Absicherungszwecken und zur Steuerung von Zinsänderungs- und Kreditrisiken eingesetzt werden, bleiben bei den in Ziff. 2 und Ziff. 3 genannten Minimal- und Maximalbeschränkungen unberücksichtigt.»

§ 33F Anlageziel und Anlagepolitik

Es wird folgende Ziffer 6 ergänzt:

«Derivate, die zu Absicherungszwecken und zur Steuerung von Zinsänderungs- und Kreditrisiken eingesetzt werden, bleiben bei den in Ziff. 2 und Ziff. 3 genannten Minimal- und Maximalbeschränkungen unberücksichtigt.»

§ 33G Anlageziel und Anlagepolitik

In § 33G wird die Terminologie korrigiert, sodass es statt Referenzindex neu Benchmark heisst. Es handelt sich um eine rein sprachliche Anpassung. Die Anlagepolitik des Teilvermögens bleibt unverändert.

Der neue Wortlaut von Ziffer 1 und 2 ist:

- «1. Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht hauptsächlich in der Erzielung langfristigen Kapitalwachstums durch die Abbildung der im Anhang genannten Benchmark.
2. a) Das Vermögen des Teilvermögens wird (neben den flüssigen Mitteln) in direkte und indirekte Anlagen in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte gemäss § 8 Ziff. 3 lit. a des Allgemeinen Teils angelegt, die in der Benchmark enthalten sind. Dabei kann die Fondsleitung statt in sämtliche Titel der Benchmark zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimized Sampling).
- b) Das Vermögen des Teilvermögens kann auch in Beteiligungswertpapiere und -rechte von Unternehmen angelegt werden, die in der Benchmark nicht enthalten sind, von denen jedoch von ihrer Börsenkapitalisierung und Marktgängigkeit her und aufgrund der für die Benchmark vorgesehenen Aufnahmekriterien mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist, dass sie bei der nächsten Anpassung in die Benchmark aufgenommen werden. Das Vermögen kann auch Beteiligungswertpapiere und -rechte von Unternehmen enthalten, die in der Benchmark nicht mehr enthalten sind, sofern diese Positionen innert angemessener Frist veräussert werden oder im Interesse der Anleger aufgrund von laufenden Kapitalmassnahmen weiterhin gehalten werden.
- c) Das Vermögen des Teilvermögens kann in Derivate (einschliesslich Warrants) auf die Benchmark und die oben erwähnten Anlagen sowie auf der Benchmark bzw. Teilsegmenten der Benchmark nahestehende Indizes angelegt werden, die eine hohe Korrelation zur Benchmark bzw. zum entsprechenden Teilsegment der Benchmark aufweisen.
- d) Das Vermögen des Teilvermögens kann in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen angelegt werden, die auf die Benchmark oder Teilsegmente der Benchmark lauten sowie auf der Benchmark bzw. Teilsegmenten der Benchmark nahestehende Indices, die eine hohe Korrelation zur Benchmark bzw. zum entsprechenden Teilsegment der Benchmark aufweisen.»

§ 33H Anlageziel und Anlagepolitik

Es wird folgende Ziffer 6 ergänzt:

«Derivate, die zu Absicherungszwecken und zur Steuerung von Zinsänderungs- und Kreditrisiken eingesetzt werden, bleiben bei den in Ziff. 2 und Ziff. 3 genannten Minimal- und Maximalbeschränkungen unberücksichtigt.»

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht nicht auf die umschriebene Änderung in § 21 erstreckt.

Dieser Publikationstext wird am 20. Mai 2020 auf der elektronischen Plattform der Swiss Fund Data AG (www.swissfunddata.ch) veröffentlicht.

Anleger, welche gegen die vorgesehenen Änderungen des Fondsvertrags Einwendung erheben wollen, müssen dies innert 30 Tagen seit der Publikation gegenüber der Aufsichtsbehörde (Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern) geltend machen (Art. 27 Abs. 3 KAG). Den bestehenden Anlegern steht zudem das Recht zu, die Auszahlung ihrer Anteile zu verlangen.

Die Vertragsänderungen im Wortlaut, der Fondsvertrag sowie die Jahresberichte können bei der Fondsleitung, der Depotbank und jedem Vertriebssträger kostenlos bezogen werden.

Zürich, den 20. Mai 2020

Die Fondsleitung
Swiss Life Asset Management AG
General-Guisan-Quai 40
8002 Zürich

Die Depotbank
UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft zu den Jahresrechnungen

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Umbrella-Fonds Swiss Life iFunds (CH) mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH)
Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)
Swiss Life iFunds (CH)
Equity Global ex Switzerland (CHF)
Swiss Life iFunds (CH)
Bond Swiss Francs Foreign (CHF)
Swiss Life iFunds (CH)
Bond Global Government + (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH)
Bond Global Corporates (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH)
Bond Swiss Francs Domestic (CHF)
Swiss Life iFunds (CH)
Equity Switzerland (CHF)
Swiss Life iFunds (CH)
Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

bestehend aus den Vermögensrechnungen und den Erfolgsrechnungen, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 lit. b–h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) für das am 30. September 2020 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrats der Fondsleitung
Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Anhang verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems, mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnungen, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern sind. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnungen abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen,

dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnungen frei von wesentlichen falschen Angaben sind.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in den Jahresrechnungen enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in den Jahresrechnungen als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnungen von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnungen. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entsprechen die Jahresrechnungen für das am 30. September 2020 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Anhang.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung gemäss Revisionsaufsichtsgesetz (RAG) und die Unabhängigkeit (Art. 11 RAG) erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbaren Sachverhalte vorliegen.

PricewaterhouseCoopers AG

Raffael Simone
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Michael Zobrist
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 14. Januar 2021

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		134 774 742.92	126 821 149.93	155 547 583.37
Klasse I-A1	CH0023989467			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		2 098.09	1 964.91	2 032.58
Anzahl Anteile im Umlauf		64 237,0000	64 543,0000	76 527,0000

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	7.8%	-2.4%	8.2%
Referenzindex: Swiss Performance Extra Index	CHF	6.8%	-1.0%	6.5%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Die Schweizer Small & Mid Caps entwickelten sich in der Berichtsperiode insgesamt positiv. Der SPI Extra Index stieg 6.83%, wobei diese Zahl darüber hinweg täuscht, dass der Index während den Monaten Oktober 2019 bis Februar 2020 rund 12% anstieg, dann jedoch durch die weltweite Covid-19-Pandemie markant einbrach. Als in der letzten Februarwoche 2020 erste Meldungen auftauchten, dass sich das Coronavirus von China nach Europa und den USA ausbreitete, setzten weltweit panikartige Wertschriftenverkäufe ein, die dazu führten, dass auch die Schweizer Small & Mid Caps innerhalb eines knappen Monats rund 33% verloren. Nach einer Bodenbildung am 23. März 2020 stiegen die Märkte wieder markant. Die Markterholung, welche bis Ende der Berichtsperiode dauerte, wurde durch noch nie dagewesene Interventionen der weltweiten Zentralbanken sowie riesigen Stimulierungspaketen von Regierungen ausgelöst.

Im Zuge der ordentlichen Indexanpassung wechselte Adecco vom SMI Index in den SPI Extra Index. Gleichzeitig stieg der grösste Small & Mid Cap, Partners Group, vom Nebenwerte Segment in den Bluechip Index auf. Somit verkauften wir Partners Group und bauten eine erste Position Adecco auf.

Zu Beginn der Berichtsperiode haben wir zyklische Titel wie Georg Fischer, SFS Group oder auch die Halbleiterunternehmen VAT und Inficon aus Bewertungsgründen reduziert. Während der covid-19-bedingten Korrektur konnten diese Aktien wie auch die Wachstumswerte Straumann und Sonova aufgebaut werden. Im Portfolio übergewichtete Titel wie BKW, Kühne & Nagel, Daetwyler, Belimo, Interroll, Comet und Schweizer hatten dank Kursgewinnen einen positiven Einfluss

auf die Performance. Negativ auf die Performance wirkten sich die Versicherungen Baloise und Helvetia aus wie auch Temenos, ams, Komax, Valora und Flughafen Zürich, welche Kursverluste verzeichneten.

Neu im Portfolio sind die Immobilienunternehmen Mobimo und PSP Swiss Property, Arbonia, Sensirion und Softwareone. Verkauft wurden Dormakaba, Dufry, Romande Energie, Tecan und Valora.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	92,68
Österreich	0,92
Total	93,60

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	7 789 887.53	3 665 630.33
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	126 383 060.41	123 225 495.24
Sonstige Vermögenswerte	849 111.88	848 383.03
Gesamtfondsvermögen	135 022 059.82	127 739 508.60
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-648 959.93
Andere Verbindlichkeiten	-247 316.90	-269 398.74
Nettofondsvermögen	134 774 742.92	126 821 149.93

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Negativzinsen	-38 050.65	-45 726.15
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	2 056 197.72	2 395 692.97
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	363 106.71	6 820.00
Erträge der Effektenleihe	51 645.49	26 582.43
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	49 579.47	83 406.61
Total Ertrag	2 482 478.74	2 466 775.86
Aufwand		
Passivzinsen	4 889.73 ²	126.78 ¹
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-909 912.81	-956 343.49
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-9 578.08	-10 066.72
Sonstige Aufwendungen	-275.12	-494.18
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-74 092.38	-198 158.12
Total Aufwand	-988 968.66	-1 164 935.73
Nettoertrag	1 493 510.08	1 301 840.13
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	8 208 719.06	-558 971.34
Realisierter Erfolg	9 702 229.14	742 868.79
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-998 974.29	-5 904 236.79
Gesamterfolg	8 703 254.85	-5 161 368.00

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	1 493 510.08	1 301 840.13
Vortrag des Vorjahres	13 931.40	35 222.77
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1 507 441.48	1 337 062.90
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-1 477 451.00	-1 323 131.50
Vortrag auf neue Rechnung	29 990.48	13 931.40

¹ Die Passivzinsen per 30.9.2019 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 15 347.35

² Die Passivzinsen per 30.9.2020 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 15 220.57

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	126 821 149.93	155 547 583.37
Ordentliche Jahresausschüttung	-1 304 620.00	-1 153 904.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	554 958.14	-22 411 161.44
Gesamterfolg	8 703 254.85	-5 161 368.00
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	134 774 742.92	126 821 149.93

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	64 543,0000	76 527,0000
Ausgegebene Anteile	15 872,0000	16 064,0000
Zurückgenommene Anteile	-16 178,0000	-28 048,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	64 237,0000	64 543,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-306,0000	-11 984,0000

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	23.4668
Brutto	CHF	23.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-8.0500
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	14.9500

Inventar des Fondsvermögens

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Österreich								
AMS AG NPV (BR)*	CHF	14 700	60 933	16 410	59 223	1 239 537	0,92	
Total Österreich						1 239 537	0,92	
Schweiz								
COMET HOLDINGS CHF1 (REGD)*	CHF	7 380	11 233	4 010	14 603	2 064 864	1,53	
DAETWYLER HLDG CHF0.05 (POST SUBDIVISION)*	CHF	13 180	4 900	5 790	12 290	2 519 450	1,87	
GALENICA AG CHF0.1*	CHF	41 474	6 600	5 970	42 104	2 703 077	2,00	
SCHWEITER TECH CHF1*	CHF	1 709	45	372	1 382	1 774 488	1,31	
SENSIRION AG NPV*	CHF		17 820		17 820	860 706	0,64	
VIFOR PHARMA AG CHF0.01*	CHF	28 211	7 770	5 600	30 381	3 809 777	2,82	
Total Schweiz						13 732 362	10,17	
Total Inhaberaktien						14 971 900	11,09	
Partizipationsscheine								
Schweiz								
LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10*	CHF	632	93	57	668	5 193 700	3,85	
SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)*	CHF	31 809	3 121	2 870	32 060	8 063 090	5,97	90
Total Schweiz						13 256 790	9,82	
Total Partizipationsscheine						13 256 790	9,82	
Namensaktien								
Schweiz								
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF		70 016		70 016	3 408 379	2,52	
ARBONIA AG CHF4.20 (REGD)*	CHF		80 661		80 661	958 253	0,71	31 204
BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)*	CHF	27 281	7 740	4 120	30 901	4 187 086	3,10	
BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)*	CHF	1 158	770	395	1 533	3 139 584	2,33	
BELIMO HOLDING AG CHF1(REGD)*	CHF	488		45	443	3 083 280	2,28	
BKW AG CHF2.5*	CHF	32 630	4 700	14 250	23 080	2 264 148	1,68	
BUCHER INDUSTRIES CHF0.20 (REGD)*	CHF	5 009	840	450	5 399	1 897 209	1,41	
CEMBRA MONEY BANK CHF1.00 (REGD)*	CHF	26 632	650	2 400	24 882	2 722 091	2,02	
CLARIANT CHF4.00(REGD)*	CHF	44 793		4 000	40 793	740 801	0,55	
CONZZETA AG CHF2 (REGD) 'A'*	CHF	925	643	85	1 483	1 465 204	1,09	
CREALOGIX HOLDING CHF10(REGD)*	CHF	6 540	200	483	6 257	744 583	0,55	
DORMAKABA HOLDING CHF0.10 'B'(REGD)*	CHF	1 505		1 505				
DUFREY AG CHF5 (REGD)*	CHF	7 175		7 175				
EMMI AG CHF10 (REGD)*	CHF	1 885	310	450	1 745	1 601 910	1,19	372
EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)*	CHF	3 042	820	1 075	2 787	2 303 456	1,71	2 115
FLUGHAFEN ZÜRICH A CHF10(REGD) POST SPLIT*	CHF	8 805	7 850	2 600	14 055	1 779 363	1,32	14 054
FORBO HLDGS AG CHF0.10(REGD)*	CHF	1 195	145	110	1 230	1 859 760	1,38	
GEORG FISCHER AG CHF1.00 (REGD)*	CHF	3 392	775	1 660	2 507	2 404 213	1,78	
HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD*	CHF	18 110	18 800	1 630	35 280	2 762 424	2,05	
IMPLENIA AG CHF1.02 (REGD)*	CHF	42 300	10 600	3 800	49 100	1 382 656	1,02	47 820
INA INVEST HOLDING CHF0.03*	CHF		21 696	21 696				
INFICON HOLDING AG CHF5(REGD)*	CHF	1 051	970	406	1 615	1 227 400	0,91	
INTERROLL HLDG AG CHF1 (REGD)*	CHF	1 177	475	555	1 097	2 550 525	1,89	601
JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*	CHF	70 183	20 870	21 650	69 403	2 725 456	2,02	55 557
KLINGELNBERG AG*	CHF	23 650			23 650	370 123	0,27	
KOMAX CHF0.10(REGD)*	CHF	9 854		4 788	5 066	810 053	0,60	4 656
KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	36 623	4 310	8 500	32 433	5 815 237	4,31	
LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)*	CHF	18		2	16	1 312 000	0,97	
LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)*	CHF	100 099	16 200	42 280	74 019	5 305 682	3,93	
MOBIMO HLDG AG CHF23.40 (REGD)*	CHF		5 550		5 550	1 501 275	1,11	5 549
OC OERLIKON CORP CHF1.00(REGD)*	CHF	117 603	27 500	10 600	134 503	988 597	0,73	134 502
ORIOR AG CHF4.00*	CHF	20 910	3 750	1 880	22 780	1 676 608	1,24	1 400
PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*	CHF	12 552	1 460	14 012				
PSP SWISS PROPERTY CHF0.10 (REGD)*	CHF		26 460		26 460	2 950 290	2,19	4 476
ROMANDE ENERGIE HO CHF25(REGD)*	CHF	826		826				
SCHAFFNER HLDG AG CHF50(REGD)*	CHF	4 015	1 440	434	5 021	906 291	0,67	
SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	2 750		1 390	1 360	340 816	0,25	1 359
SFS GROUP AG CHF0.1*	CHF	24 440	3 120	5 560	22 000	2 038 300	1,51	
SIEGFRIED HLDG AG CHF27 (REGD)*	CHF	3 544	150	660	3 034	1 912 937	1,42	1 866
SOFTWAREONE HLD AG CHF0.01*	CHF		31 340		31 340	807 005	0,60	29 725
SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*	CHF	19 314	15 174	6 128	28 360	6 624 896	4,91	
STADLER RAIL AG*	CHF	31 267	26 610	22 621	35 256	1 350 305	1,00	35 255
STRAUMANN HLDG CHF0.1(REGD)*	CHF	5 245	1 256	750	5 751	5 348 430	3,96	5 750
SULZER AG CHF0.01*	CHF	15 189	10 610	5 730	20 069	1 486 109	1,10	
SUNRISE COMMUNICA CHF1*	CHF	26 287		10 740	15 547	1 694 623	1,26	
SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)*	CHF	21 453	6 100	2 000	25 553	1 057 894	0,78	
TECAN GROUP AG CHF0.10(REGD)*	CHF	2 526		2 526				
TEMENOS AG CHF5 (REGD)*	CHF	29 819	12 160	11 780	30 199	3 746 186	2,77	
TX GROUP CHF10 (REGD)*	CHF	5 676		1 000	4 676	310 954	0,23	
VALIANT HOLDING AG CHF3.30(REGD)*	CHF	15 330		1 380	13 950	1 082 520	0,80	
VALORA HOLDING CHF1(REGD)*	CHF	5 480	1 350	6 830				
VAT GROUP AG CHF0.10*	CHF	7 738	12 165	4 770	15 133	2 664 921	1,97	15 132
VZ HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*	CHF		15 850	7 650	8 200	674 040	0,50	
ZUR ROSE GP AG CHF30.00*	CHF	10 785		10 010	775	170 500	0,13	
Total Schweiz						98 154 371	72,70	
Total Namensaktien						98 154 371	72,70	

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Anrechte							
Österreich							
AMS AG RIGHTS 30.03.20*	CHF	34 223	34 223				
Total Österreich						0,00	
Schweiz							
CREALOGIX HOLDING AG RIGHTS 29.10.19*	CHF	6 540	6 540				
Total Schweiz						0,00	
Total Anrechte						0,00	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					126 383 060	93,60	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Namensaktien							
Schweiz							
VZ HOLDINGS CHF0.25**	CHF	4 180	4 180				
Total Schweiz						0,00	
Total Namensaktien						0,00	
Anrechte							
Schweiz							
INA INVEST HOLDING LTD RIGHTS 10.06.20**	CHF	45 200	45 200				
Total Schweiz						0,00	
Total Anrechte						0,00	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						0,00	
Total Wertschriften					126 383 060	93,60	
(davon ausgeliehen)					24 668 989	18,27	
Bankguthaben auf Sicht					7 789 888	5,77	
Sonstige Vermögenswerte					849 112	0,63	
Gesamtfondsvermögen					135 022 060	100,00	
Andere Verbindlichkeiten					-247 317		
Nettofondsvermögen					134 774 743		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	126 383 060	93,60
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	-	-
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	126 383 060	93,60

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
Klasse I-A1: 0,7125% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
Klasse I-A1: 0,80% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission:
Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission
Klasse gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.;

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:
Klasse I-A1:

0,72%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		315 397 138.74	171 619 320.28	233 565 244.05
Klasse I-A1	CH0023989509			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 265.79	1 269.19	1 249.55
Anzahl Anteile im Umlauf		249 170,0000	135 220,0000	186 920,0000

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	1.4%	3.4%	12.4%
Benchmark/Index:				
MSCI World ex Switzerland, net dividend, reinvested (in CHF)	CHF	1.7%	3.7%	12.6%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Das Portfolio investiert passiv in den MSCI World ex Switzerland Index, net dividend, reinvested (in CHF). Über das ganze Berichtsjahr verteilt wurden in den quartalsweise stattfindenden MSCI Index Reviews total 101 Titel im Index aufgenommen und 131 Titel aus dem Index gestrichen. Weiter gab es verschiedene Anpassungen der Anzahl Aktien und den «Foreign Inclusion» Faktoren im Index. Der Gesamtumsatz der vier Quartals-Reviews betrug 6.15%.

Im vierten Quartal 2019 hat Bristol-Myers Squibb die Firma Celgene gegen Bar und Aktien übernommen. Suntrust Banks wurde durch BB&T gegen Aktien übernommen.

Im ersten Quartal 2020 wurde Wellcare Health Plans durch Cenete gegen Bar und Aktien übernommen. Just Eat Takeaway.com wurde nach der Übernahme eines Nebenwertes in den Index aufgenommen.

Im zweiten Quartal 2020 wurden Carrier Global und Otis Worldwide aufgrund zweier unterschiedlicher Spin Off's von United Technologies in den Index aufgenommen. Raytheon wurde durch United Technologies gegen Aktien übernommen. Abbvie hat Allergan gegen Bar und Aktien übernommen.

Im dritten Quartal 2020 wurden die Gewichte im Index der Aktien von Match.com aufgrund vom Spin Off von IAC Interactive erhöht. Siemens Energy wurde nach dem Spin Off von Siemens im Index aufgenommen.

Die Aktivitäten im Portfolio reflektieren diese Änderungen.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten	66,45
Japan	8,03
Grossbritannien	4,29
Kanada	3,21
Frankreich	3,21
Deutschland	3,06
Australien	2,11
Niederlande	1,53
Schweden	1,07
Hongkong	0,98
Übrige	4,46
Total	98,40

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	4 648 638.97	1 564 055.32
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	311 308 588.82	170 728 978.08
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	16 700.17	10 121.37
Derivative Finanzinstrumente	3 132.29	2 632.23
Sonstige Vermögenswerte	412 583.95	444 854.03
Gesamtfondsvermögen	316 389 644.20	172 750 641.03
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-716 602.19	-966 742.57
Andere Verbindlichkeiten	-275 903.27	-164 578.18
Nettofondsvermögen	315 397 138.74	171 619 320.28

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	11 862.35	16 281.92
Negativzinsen	-2 964.80	-2 915.16
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	3 002 753.80	2 991 249.81
– aus Gratisaktien	111 816.33	151 587.39
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	1 947.63	678.62
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	915 442.68	849 940.20
Erträge der Effektenleihe	75 399.28	80 001.38
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	-1 026.94	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	1 113 934.75	172 342.62
Total Ertrag	5 229 165.08	4 259 166.78
Aufwand		
Passivzinsen	-315.05	215.54 ¹
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-778 802.59	-596 554.32
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-18 691.27	-14 317.89
Sonstige Aufwendungen	-3 384.00	-494.30
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-373 272.67	-615 797.13
Total Aufwand	-1 174 465.58	-1 226 948.10
Nettoertrag	4 054 699.50	3 032 218.68
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	689 966.36	12 383 830.06
Realisierter Erfolg	4 744 665.86	15 416 048.74
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	246 312.18	-13 947 237.42
Gesamterfolg	4 990 978.04	1 468 811.32

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	4 054 699.50	3 032 218.68
Vortrag des Vorjahres	2 598.54	12 829.86
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4 057 298.04	3 045 048.54
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-3 986 720.00	-3 042 450.00
Vortrag auf neue Rechnung	70 578.04	2 598.54

¹ Die Passivzinsen per 30.9.2019 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 1 041.32

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	171 619 320.28	233 565 244.05
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 048 200.00	-3 065 570.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	142 835 040.42	-60 349 165.09
Gesamterfolg	4 990 978.04	1 468 811.32
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	315 397 138.74	171 619 320.28

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	135 220,0000	186 920,0000
Ausgegebene Anteile	150 350,0000	22 260,0000
Zurückgenommene Anteile	-36 400,0000	-73 960,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	249 170,0000	135 220,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	113 950,0000	-51 700,0000

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	16.2832
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	16.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-5.6000
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	10.4000
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	16.0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Inhaberaktien							
Australien							
AFTERPAY LTD NPV*	AUD		1 718	1 718	90 495	0,03	
AGL ENERGY NPV*	AUD	2 187	3 816	6 003	53 841	0,02	6 003
ALUMINA LTD NPV*	AUD	8 875		8 875			
AMP LIMITED NPV(POST RECON)*	AUD	20 110	18 411	38 521	33 103	0,01	
AMPOL LTD*	AUD	991	1 028	2 019			
APA GROUP NPV*	AUD	4 659	5 533	10 192	69 331	0,02	10 192
ARISTOCRAT LEISURE NPV*	AUD	2 183	4 710	1 769	5 124	0,03	
ASX LTD NPV*	AUD	819	1 434	412	1 841	0,03	1 841
AURIZON HOLDINGS NPV*	AUD	9 974		9 974	27 914	0,01	
AUSNET SERVICES NPV*	AUD	17 375		17 375	21 510	0,01	17 375
AUST & NZ BANK GRP NPV*	AUD	11 935	12 203	2 468	21 670	0,08	
BK OF QUEENSLAND NPV*	AUD	2 108		2 108			
BLUESCOPE STEEL NPV*	AUD	2 655		2 655	22 204	0,01	
BORAL LIMITED NPV*	AUD	5 200		5 200			
BRAMBLES LTD NPV*	AUD	7 192	6 192	13 384	92 454	0,03	
CHALLENGER LIMITED NPV*	AUD	923	4 189	5 112			
CIMIC GROUP LTD NPV*	AUD		2 043	1 967	76	0,00	
CMNWLTH BK OF AUST NPV*	AUD	7 482	8 082	2 082	13 482	0,18	11 676
COCA-COLA AMATIL NPV*	AUD	676	2 460	3 136	19 618	0,01	3 136
COCHLEAR LTD NPV*	AUD	240	558	364	434	0,02	234
COMPUTERSHARE LTD NPV(POST REC)*	AUD	2 701	2 223	4 924	39 624	0,01	4 026
CROWN RESORTS LTD NPV*	AUD	519	2 865	3 384	19 588	0,01	
CSL NPV*	AUD	1 937	2 086	424	3 599	0,01	
DEXUS NPV (STAPLED)*	AUD	4 206	2 886	7 092	41 518	0,01	
EVOLUTION MINING NPV*	AUD		10 000	10 000	37 865	0,01	
FORTESCUE METALS G NPV*	AUD	7 408	6 673	14 081	151 142	0,05	
GOODMAN GROUP (STAPLED SECURITY)*	AUD	6 971	7 058	2 055	11 974	0,04	
GPT GROUP NPV (STAPLED SECURITIES)*	AUD	11 629		11 629	29 866	0,01	10 000
HARVEY NORMAN HLDG NPV*	AUD	2 304	135	2 439			
INCITEC PIVOT NPV*	AUD	9 400		9 400			
INSURANCE AUST GRP NPV*	AUD	11 388	5 816		17 204	0,02	17 204
LEND LEASE GROUP NPV*	AUD	2 864	4 248	2 149	4 963	0,01	
MACQUARIE GP LTD NPV*	AUD	1 361	1 521	356	2 526	0,06	2 526
MEDIBANK PRIVATE L NPV*	AUD	16 047	10 221	26 268	43 418	0,01	26 268
MIRVAC GROUP STAPLED SECURITIES*	AUD	20 604		20 604	29 578	0,01	
NATL AUSTRALIA BK NPV*	AUD	11 754	15 321	2 673	24 402	0,09	
NEWCREST MINING NPV*	AUD	3 660	3 026	6 686	137 544	0,04	
NTHN STAR RES LTD NPV*	AUD		6 029	6 029	54 153	0,02	
OIL SEARCH LTD PGKO.10*	AUD	7 754	10 182	17 936	31 181	0,01	
ORICA LIMITED NPV*	AUD	1 110	3 177	4 287	43 560	0,01	
ORIGIN ENERGY NPV*	AUD	6 529	4 017	10 546	29 862	0,01	
QANTAS AIRWAYS NPV*	AUD		4 766	4 766	12 711	0,00	4 766
QBE INS GROUP NPV*	AUD	6 123	6 571	12 694	71 973	0,02	
RAMSAY HEALTH CARE NPV*	AUD	472	1 183	1 655	72 017	0,02	
REA GROUP LIMITED NPV*	AUD	245	720	341	624	0,01	624
RIO TINTO LIMITED NPV*	AUD	1 586	1 395	2 981	185 153	0,06	2 981
SANTOS LIMITED NPV*	AUD	6 159	11 224	4 896	12 487	0,01	12 487
SCENTRE GROUP NPV STAPLED UNIT*	AUD	27 101	12 566	39 667	57 467	0,02	
SEEK LIMITED NPV*	AUD	1 795	1 666	1 302	30 269	0,01	2 159
SONIC HEALTHCARE NPV*	AUD	1 932	2 221	1 023	3 130	0,02	
SOUL PATTINSON(WH) NPV*	AUD		1 742	1 742			
SOUTH32 LTD NPV*	AUD	23 897		23 897			
STOCKLAND NPV (STAPLED)*	AUD	14 113		14 113	35 130	0,01	14 113
SUNCORP GROUP LTD NPV*	AUD		12 499	2 938	9 561	0,02	
SYDNEY AIRPORT NPV(STAPLED SECURITY)*	AUD	3 684	5 463	9 147	35 297	0,01	
TABCORP HLDGS LTD NPV*	AUD	12 212	1 110	13 322	29 301	0,01	12 212
TELSTRA CORP NPV*	AUD	21 460		21 460	39 286	0,01	
TPG TELECOM LTD NPV*	AUD	809	3 541	4 350			
TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS NPV*	AUD	11 788	11 075	2 199	20 664	0,06	
TREASURY WINE ESTA NPV*	AUD	2 901	3 757	2 582	4 076	0,01	
VICINITY CENTRES NPV (STAPLED SECURITY)*	AUD	22 085	17 951	40 036	36 251	0,01	
WESFARMERS LTD NPV*	AUD	4 764	6 083	1 374	9 473	0,09	
WESTPAC BKG CORP NPV*	AUD	14 574	18 280	5 053	27 801	0,10	
WISETECH GLOBAL LT NPV*	AUD		2 268	1 266	1 002	0,01	1 002
WOODSIDE PETROLEUM NPV*	AUD	4 409	7 386	2 860	8 935	0,03	
WOOLWORTHS GRP LTD NPV*	AUD	5 229	5 384	1 027	9 586	0,07	
WORLEY LIMITED NPV*	AUD	1 835	3 042	4 877			
Total Australien					5 541 661	1,75	
Österreich							
ANDRITZ AG NPV(BR)*	EUR	533		533	15 137	0,00	533
ERSTE GROUP BK AG NPV*	EUR	1 567	954	2 521	48 549	0,02	
OMV AG NPV(VAR)*	EUR	548	1 007	1 555	39 202	0,01	
RAIFFEISEN BK INTL NPV (REGD)*	EUR	705		705	9 927	0,00	705
VERBUND AG CLASS'A'NPV*	EUR	183	385	568	28 566	0,01	568
VOESTALPINE AG NPV*	EUR	528		528	12 799	0,00	528
Total Österreich					154 181	0,05	
Belgien							
ANHEUSER-BUSCH IN NPV*	EUR	3 267	3 586	512	6 341	0,10	6 341
COLRUYT SA NPV*	EUR	450	703	450	703	0,01	703
ELIA SYS OPERATOR NPV*	EUR		390	172	218	0,01	218
GALAPAGOS NV NPV*	EUR		552	90	462	0,02	93
GPE BRUXELLES LAM NPV*	EUR	397	1 007	430	974	0,03	607
PROXIMUS SA NPV*	EUR	270	1 550	1 820	30 540	0,01	1 820
SOFINA NPV*	EUR		124	124	31 127	0,01	
SOLVAY SA NPV*	EUR	335	240	575	45 508	0,01	
UMICORE NPV*	EUR	682	890	1 572	60 209	0,02	1 572
Total Belgien					686 221	0,22	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Kanada								
AIR CANADA VAR VTG SHS NPV*	CAD	600	2 601	1 633	1 568	16 922	0,01	1 568
ALGONQUIN PWR&UTIL COM NPV*	CAD		4 300		4 300	57 200	0,02	
ALTAGAS LTD COM NPV*	CAD	1 392	1 715		3 107	34 364	0,01	3 107
ATCO LTD CL 1 NON VTG*	CAD	400			400	10 590	0,00	
AURORA CANNABIS IN COM NPV*	CAD	3 600		3 600				
B2GOLD CORP COM NPV*	CAD		7 700		7 700	45 918	0,01	6 900
BOMBARDIER INC CLASS'B'SUB-VTG NPV*	CAD	15 700		15 700				
CAE INC COM NPV*	CAD	900	1 684		2 584	34 622	0,01	2 584
CAMECO CORP COM*	CAD	2 549	3 180	3 611	2 118	19 594	0,01	
CANADIAN UTILS LTD CL A*	CAD	755			755	16 493	0,01	
CANOPY GROWTH CORP COM NPV*	CAD	800			800	10 504	0,00	800
CI FINANCIAL CORP COM NPV*	CAD	1 500	1 240	1 500	1 240	14 405	0,00	
EMERA INC COM*	CAD	800	2 675	908	2 567	96 580	0,03	2 567
EMPIRE LTD CL A*	CAD	700	2 197	1 827	1 070	28 445	0,01	
HUSKY ENERGY INC COM*	CAD	2 589		2 589				
HYDRO ONE INC COM NPV*	CAD	1 265	1 271		2 536	49 224	0,02	
IGM FINANCIAL INC COM*	CAD	607			607	12 746	0,00	
KEYERA CORPORATION COM NPV*	CAD	574	824		1 398	19 327	0,01	
KINROSS GOLD CORP COM NPV*	CAD	5 833	4 480		10 313	83 348	0,03	
KIRKLAND LAKE GOLD COM NPV*	CAD	800	1 461	476	1 785	79 804	0,03	1 785
LUNDIN MINING CORP COM*	CAD	4 600	3 495	3 651	4 444	22 711	0,01	4 168
METHANEX CORP COM*	CAD	100	617	717				
ONEX CORP SUB VTG*	CAD	400	411		811	33 134	0,01	
PAN AMER SILVER COM NPV*	CAD		1 738		1 738	51 176	0,02	1 738
PRAIRIESKY ROYALTY COM NPV*	CAD	1 044		1 044				
QUEBECOR INC CL B*	CAD	800	888		1 688	38 674	0,01	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS COM*	CAD		775		775	42 096	0,01	
SSR MINING INC COM NPV*	CAD		2 200		2 200	37 603	0,01	1 551
STARS GROUP INC(TH COM NPV)*	CAD	900	754	1 654				
TELUS CORPORATION NPV*	CAD	491	3 788	1 004	3 275	53 026	0,02	
TMX GROUP LTD COM NPV*	CAD		723	200	523	49 261	0,02	
TOURMALINE OIL CP COM NPV*	CAD	1 400		1 400				
VERMILION ENERGY I COM NPV*	CAD	864		864				
WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)*	CAD	1 096			1 096	104 332	0,03	
WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)*	USD	9	1 445	607	847	80 775	0,03	
WEST FRASER TIMBER COM NPV*	CAD	400		400				
WSP GLOBAL INC COM NPV*	CAD	400	345		745	44 806	0,01	745
YAMANA GOLD INC COM*	CAD		8 699		8 699	45 294	0,01	
Total Kanada						1 232 975	0,39	
China								
YANGZJIANG SHIPBU NPV*	SGD		29 100		29 100	19 389	0,01	
Total China						19 389	0,01	
Dänemark								
A.P. MOELLER-MAERSK SER'B'DKK1000*	DKK	30	25		55	80 242	0,03	25
A.P. MOLLER-MAERSK 'A'DKK1000*	DKK	23	20		43	58 098	0,02	
AMBU A/S SER'B'DKK0.5*	DKK		1 486	542	944	24 594	0,01	944
CHR. HANSEN HLDG DKK10*	DKK	472	337		809	82 643	0,03	809
DANSKE BANK A/S DKK10*	DKK	3 288	3 256	1 211	5 333	66 459	0,02	
DSV PANALPINA A/S DKK1*	DKK	1 021	1 061	185	1 897	284 861	0,09	1 652
GENMAB AS DKK1 (BEARER)*	DKK	275	261	59	477	158 790	0,05	
GN STORE NORD DKK4*	DKK		1 001		1 001	69 659	0,02	1 001
ISS A/S DKK1*	DKK	835		835				
NOVOZYMES A/S SER'B'DKK2 (POST CONS)*	DKK	709	906		1 615	93 476	0,03	1 615
ØRSTED A/S DKK10*	DKK	750	978	306	1 422	180 171	0,06	490
PANDORA A/S DKK1*	DKK	251	1 317	673	895	59 290	0,02	895
Total Dänemark						1 158 282	0,37	
Finnland								
KONE CORPORATION NPV ORD 'B'*	EUR	1 627	1 262	367	2 522	203 948	0,06	
METSO OUTOTEC OYJ NPV*	EUR		3 195	1	3 194	20 630	0,01	
METSO OYJ NPV*	EUR	673	620	1 293				
WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50*	EUR	2 376			2 376	17 197	0,01	2 376
Total Finnland						241 775	0,08	
Frankreich								
ACCOR EUR3*	EUR	967	757		1 724	44 577	0,01	1 724
ADP EUR3*	EUR	167			167	15 356	0,00	167
AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)*	EUR	1 867	2 145	411	3 601	525 688	0,17	3 601
AIRBUS EUR1*	EUR	2 535	2 326	397	4 464	298 519	0,09	
ALSTOM EUR7.00*	EUR	438	917		1 355	62 072	0,02	
AMUNDI EUR2.5 (AIW)*	EUR	200	270		470	30 483	0,01	
ARKEMA EUR10*	EUR	334	245		579	56 529	0,02	
ATOS SE EUR1*	EUR	352	552	221	683	50 626	0,02	
AXA EUR2.29*	EUR	8 244	8 948	2 692	14 500	246 451	0,08	14 500
BIC EUR3.82*	EUR	118		118				
BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)*	EUR	172	138		310	44 687	0,01	109
BNP PARIBAS EUR2*	EUR	4 800	4 260	470	8 590	286 662	0,09	
BOLLORE EURO.16*	EUR	5 399	5 674	5 399	5 674	19 488	0,01	5 674
BOUYGUES EUR1*	EUR	860	1 217	586	1 491	47 580	0,02	
BUREAU VERITAS EURO.12*	EUR	1 673	914		2 587	53 681	0,02	5
CAPGEMINI EUR8*	EUR	661	624		1 285	151 940	0,05	
CARREFOUR EUR2.50*	EUR	2 552	2 962		5 514	81 179	0,03	5 514
CASINO GUICH-PERR EUR1.53*	EUR	294		294				
CIE DE ST-GOBAIN EUR4*	EUR	1 855	2 467		4 322	167 677	0,05	
CNP ASSURANCES EUR1*	EUR	537			537	6 179	0,00	537
COVIVIO EUR3*	EUR	172	345		517	33 476	0,01	517
CREDIT AGRICOLE SA EUR3*	EUR	5 564	3 585		9 149	73 651	0,02	
DANONE EURO.25*	EUR	2 657	2 343	323	4 677	278 246	0,09	
DASSAULT AVIATION EUR8*	EUR	7			7	5 468	0,00	7
DASSAULT SYSTEMES EURO.50*	EUR	523	508		1 031	177 446	0,06	1 031
EDENRED EUR2*	EUR	987	954		1 941	80 301	0,03	1 941

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
EDF EURO.5*	EUR	2 924	4 152	1 540	5 536	53 834	0,02	
EIFFAGE EUR4*	EUR	388			626	47 089	0,01	
ENGIE EUR1*	EUR	8 281	6 560	1 487	13 354	164 302	0,05	
ESSILORLUXOTTICA EURO.18*	EUR	1 182	1 143	149	2 176	272 298	0,09	
EURAZEO NPV*	EUR	179			179	8 910	0,00	
EUROFINS SCIENTIFI EURO.10*	EUR	58	37		95	69 127	0,02	7
EUTELSAT COMMUNICA EUR1*	EUR	935		935				
FAURECIA EUR7*	EUR	114	440		554	22 036	0,01	554
GETLINK SE EURO.40*	EUR	1 548	1 974		3 522	44 016	0,01	
HERMES INTL NPV*	EUR	152	103		255	202 256	0,06	
ICADE NPV*	EUR	257			257	13 268	0,00	
ILIAD NPV*	EUR	166		97	69	11 675	0,00	69
IMERY'S EUR2*	EUR	176		176				
INGENICO GROUP EUR1*	EUR	156	325		481	68 560	0,02	481
IPSEN EUR1*	EUR	186			186	17 945	0,01	
JC DECAUX SA NPV*	EUR	517			517	8 227	0,00	517
KERING EUR4*	EUR	329	293	47	575	351 622	0,11	575
KLEPIERRE EUR1.40*	EUR	828	664		1 492	19 265	0,01	1 492
L'OREAL EURO.20*	EUR	1 093	1 120	286	1 927	576 324	0,18	
LEGRAND SA EUR4*	EUR	1 163	931	254	1 840	135 158	0,04	
LVMH MOËT HENNESSY EURO.30*	EUR	1 196	1 167	241	2 122	913 102	0,29	
NATIXIS EUR1.6*	EUR	3 853			3 853	7 981	0,00	
ORANGE EUR4*	EUR	8 213	7 407		15 620	149 505	0,05	
ORPEA EUR2.5*	EUR		685	286	399	41 723	0,01	399
PERNOD RICARD EUR1.55*	EUR	901	766		1 667	244 523	0,08	
PEUGEOT SA EUR1*	EUR	2 638	2 606		5 244	87 571	0,03	5 244
PUBLICIS GROUPE SA EURO.40*	EUR	808	2 227	1 017	2 018	59 963	0,02	2 018
REMY COINTREAU EUR1.60*	EUR	129			129	21 653	0,01	129
RENAULT SA EUR3.81*	EUR	854	858		1 712	40 938	0,01	1 712
SAFRAN EURO.20*	EUR	1 450	1 272	294	2 428	220 883	0,07	
SANOFI EUR2*	EUR	4 853	5 008	1 196	8 665	796 592	0,25	
SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)*	EUR	87	126		213	67 605	0,02	
SCHNEIDER ELECTRIC EUR8*	EUR	2 254	2 180	261	4 173	476 787	0,15	
SCOR SE EUR7.876972 (POST CONS)*	EUR	492	1 166		1 658	42 263	0,01	
SEB SA EUR1*	EUR	57	152		209	31 276	0,01	209
SOC GENERALE EUR1.25*	EUR	3 035	4 048	1 236	5 847	71 297	0,02	
SODEXO EUR4*	EUR	446	270		716	47 071	0,01	716
STMICROELECTRONICS EUR1.04*	EUR	3 391	2 055	697	4 749	134 358	0,04	
SUEZ EUR4*	EUR	1 100	1 584		2 684	45 703	0,01	2 684
TELEPERFORMANCE EUR2.50*	EUR	255	177		432	122 686	0,04	432
THALES EUR3*	EUR	510	802	431	881	60 898	0,02	881
TOTAL SE EUR2.5*	EUR	10 332	10 502	1 443	19 391	610 027	0,19	3 279
UBISOFT ENTERTAIN EURO.31*	EUR	258	599	240	617	51 225	0,02	617
VALEO EUR1 (POST SUBD)*	EUR	829	1 551	743	1 637	46 296	0,01	
VEOLIA ENVIRONNEME EUR5*	EUR	2 188	1 907		4 095	81 266	0,03	
VINCI EUR2.50*	EUR	2 327	2 245	552	4 020	309 756	0,10	4 020
VIVENDI SA EUR5.50*	EUR	4 033	2 463		6 496	166 567	0,05	
WENDEL EUR4*	EUR	89			89	7 426	0,00	
WORLDLINE EURO.68*	EUR	455	649		1 104	83 402	0,03	1 104
Total Frankreich						9 964 218	3,15	

Deutschland

1&1 DRILLISCH AG NPV*	EUR	261		261				
AROUNDTOWN SA EURO.01*	EUR	3 935	9 355	4 440	8 850	40 904	0,01	8 850
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1*	EUR	1 454	2 151	688	2 917	194 816	0,06	
BEIERSDORF AG NPV*	EUR	361	701	225	837	87 471	0,03	499
CARL ZEISS MEDITEC NPV*	EUR	125	190		315	36 652	0,01	315
COMMERZBANK AG NPV*	EUR	4 857	4 341		9 198	41 551	0,01	9 198
CONTINENTAL AG ORD NPV*	EUR	411	590	188	813	81 004	0,03	813
COVESTRO AG NPV*	EUR	718	1 018	494	1 242	56 668	0,02	1 242
DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)*	EUR	1 315	1 724	411	2 628	120 870	0,04	
FRAPORT AG NPV*	EUR	229	399		628	22 855	0,01	628
FRESENIUS MED CARE NPV*	EUR	817	993	234	1 576	122 286	0,04	
FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV*	EUR	1 845	1 972	722	3 095	129 477	0,04	
GEA GROUP AG NPV*	EUR	566	565		1 131	36 567	0,01	
HEIDELBERGCEMENT NPV*	EUR	566	594		1 160	65 387	0,02	1 160
HENKEL AG & CO KGAA*	EUR	439	681	225	895	77 043	0,02	
HOCHTIEF AG NPV*	EUR	140			140	10 023	0,00	140
INNOGY SE NPV (ASD 06/07/18 EON CSH)*	EUR	15		15				
KION GROUP AG NPV*	EUR	409	377	303	483	38 081	0,01	483
KNORR BREMSE AG NPV*	EUR	271	188		459	49 768	0,02	
LANXESS AG NPV*	EUR	468	373		841	44 352	0,01	
MERCK KGAA NPV*	EUR	608	694	221	1 081	145 056	0,05	1 081
METRO AG (NEW) NPV*	EUR	507	1 559		2 066	18 964	0,01	2 066
NEMETSCHKE SE ORD NPV*	EUR		1 097	268	829	55 821	0,02	829
PUMA SE NPV*	EUR	340	335		675	55 895	0,02	
RWE AG (NEU) NPV*	EUR	2 696	3 868	1 382	5 182	178 543	0,06	
SAP AG ORD NPV*	EUR	4 225	5 235	1 266	8 194	1 172 004	0,37	
SYMRISE AG NPV (BR)*	EUR	578	517	167	928	117 977	0,04	
TEAMVIEWER AG NPV*	EUR		1 173		1 173	53 229	0,02	1 173
THYSSENKRUPP AG NPV*	EUR	1 052	4 254	2 556	2 750	12 775	0,00	2 750
VOLKSWAGEN AG ORD NPV*	EUR	84	135		219	35 203	0,01	
WIRECARD AG NPV*	EUR	528	454		982			
ZALANDO SE NPV*	EUR	564	1 046	493	1 117	96 154	0,03	1 117
Total Deutschland						3 197 395	1,01	

Hongkong

AIA GROUP LTD NPV*	HKD	51 800	52 400	10 800	93 400	840 397	0,27	
ASM PACIFIC TECH HKD0.10*	HKD	1 600	2 000		3 600	33 630	0,01	3 600
BANK OF EAST ASIA NPV*	HKD	7 702	44		7 746	13 076	0,00	5 089
BOC HONG KONG HLDG HKD5*	HKD	18 000	14 000		32 000	77 388	0,02	
CK ASSET HOLDINGS HKD1*	HKD	11 892	11 500		23 392	104 684	0,03	
CK HUTCHISON HLDGS HKD1.0*	HKD	11 392	12 000		23 392	129 226	0,04	
CK INFRASTRUCTURE HKD1*	HKD	4 000			4 000	17 142	0,01	
CLP HOLDINGS HKD5*	HKD	8 000	6 000		14 000	119 497	0,04	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GALAXY ENTERTAINME HKD0.10*	HKD	9 000	16 000	5 000	20 000	123 172	0,04	1
HANG LUNG PROP HKD1*	HKD	12 000			12 000	27 854	0,01	12 000
HANG SENG BANK HKD5*	HKD	3 800	3 600	1 400	6 000	81 158	0,03	3 788
HENDERSON LAND DEV HKD2*	HKD	5 531	9 000		14 531	49 181	0,02	14 531
HK ELECTRIC INVEST UNITS (STAPLED)*	HKD	20 000			20 000	18 968	0,01	20 000
HKT TRUST AND HKT SHARE STAPLED UNIT*	HKD	20 060	13 000		33 060	40 211	0,01	
HONG KONG EXCHANGE HKD1*	HKD	4 780	6 119	1 600	9 299	398 842	0,13	9 299
HONGKONG LAND HLD ORD USD0.10(SINGAPORE REG)*	USD	5 200	4 300		9 500	32 381	0,01	
HONGKONG&CHINA GAS HKD0.25*	HKD	41 937	48 297	1	90 233	118 736	0,04	18 092
HYSAN DEVELOPMENT HKD5*	HKD	3 064		3 064	1 600	58 330	0,02	1 600
JARDINE MATHESON COM USD0.25(BERMUDA REG)*	USD	1 000	1 400	800	1 600	54 601	0,02	
JARDINE STRATEGIC ORD USD0.05(BERMUDA REG)*	USD	700	2 300		3 000	54 601	0,02	
KERRY PROPERTIES HKD1*	HKD	500			500	1 172	0,00	
MGM CHINA HLDGS LT HKD1*	HKD	6 400		6 400				
MTR CORP HKD1*	HKD	8 081	210		8 291	37 595	0,01	62
NEW WORLD DEVEL CO HKD1*	HKD	20 132	21 000	41 132				
NWS HOLDINGS LTD HKD1*	HKD	8 435		8 435				
PCCW LIMITED HKD0.25*	HKD	21 603			21 603	11 832	0,00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD HKD1*	HKD	7 500	4 500		12 000	57 757	0,02	8 376
SHANGRI-LA ASIA HKD1*	HKD	6 500		6 500				
SINO LAND CO HKD1*	HKD	19 923			19 923	21 257	0,01	
SJM HOLDINGS LTD. HKD1.00*	HKD	9 000	22 000	16 000	15 000	16 235	0,01	15 000
SUN HUNG KAI PROP NPV*	HKD	6 771	8 500	4 500	10 771	126 156	0,04	9 500
SWIRE PACIFIC 'A'HKD0.60*	HKD	2 000	3 500		5 500	24 255	0,01	
SWIRE PROPERTIES LTD HKD1*	HKD	6 600			6 600	15 961	0,01	6 600
TECHTRONIC INDUSTR HKD0.1*	HKD	6 500	5 500	2 000	10 000	120 445	0,04	
THE LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST*	HKD	10 000	8 700	2 700	16 000	119 497	0,04	
VITASOY INTL HKD0.25*	HKD	2 000	8 000	10 000				
WH GROUP LTD USD0.0001*	HKD	35 000	56 500		91 500	68 120	0,02	
WHARF REAL ESTATE HKD0.1*	HKD	4 900	13 000	4 000	13 900	51 906	0,02	13 900
WHARF(HLDGS) HKD1*	HKD	5 900	7 000	12 900				
WHEELOCK & COMPANY HKD0.50*	HKD	4 000	3 000	7 000				
YUE YUEN INDL HLDG HKD0.25*	HKD	3 000		3 000				
Total Hongkong						3 010 663	0,95	
Irland								
AIB GROUP PLC ORD EURO.625*	EUR	2 298		2 298				
BANK OF IRELAND GR EUR1*	EUR	4 969		4 969				
DCC ORD EURO.25*	GBP	347	515		862	61 513	0,02	
FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09*	EUR	307	370		677	98 977	0,03	
FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09*	GBP		373	1	372	54 126	0,02	
KERRY GROUP 'A'ORD EURO.125(DUBLIN LIST)*	EUR	794	383	260	917	108 181	0,03	
Total Irland						322 797	0,10	
Israel								
AZRIELI GROUP ILS0.01*	ILS	209			209	8 590	0,00	
BANK HAPOLIM B.M. ILS1*	ILS	4 419	6 085		10 504	51 634	0,02	
BK LEUMI LE ISRAEL ILS1*	ILS	6 954	6 991		13 945	56 488	0,02	
CHECK POINT SFTWRE ORD ILS0.01*	USD	566	863	636	793	87 676	0,03	793
CYBER-ARK SOFTWARE COM ILS0.01*	USD	200	500	300	400	38 007	0,01	400
ICL GROUP LTD ILS1*	ILS	2 832			2 832	9 220	0,00	
ISRAEL DISCOUNT BK ILS0.10 SER'A**	ILS		5 367		5 367	13 321	0,00	
NICE SYSTEMS ILS1*	ILS	288	271		559	116 206	0,04	
WIX.COM LTD COM ILS0.01*	USD	200	200		400	93 657	0,03	
Total Israel						474 799	0,15	
Italien								
ASSIC GENERALI SPA EUR1*	EUR	4 858	6 227	4 098	6 987	90 519	0,03	
DIASORIN SPA EUR1*	EUR		201		201	37 225	0,01	161
FINECOBANK SPA EURO.33*	EUR	2 751	2 475		5 226	66 185	0,02	1 756
INFRASTRUTTURE WIR NPV*	EUR		3 212	1 760	1 452	14 767	0,00	
LEONARDO SPA EUR4.40*	EUR	1 049	2 123		3 172	17 087	0,01	3 172
POSTE ITALIANE SPA NPV*	EUR	2 205	2 241		4 446	36 251	0,01	4 446
TELECOM ITALIA SPA DI RISP EURO.55*	EUR	31 138	68 326	30 784	68 680	25 513	0,01	
TELECOM ITALIA SPA EURO.55*	EUR	27 550	44 606		72 156	26 587	0,01	72 156
Total Italien						314 134	0,10	
Japan								
ACOM CO NPV*	JPY	2 600			2 600	10 299	0,00	
ADVANTEST CORP NPV*	JPY	800	900		1 700	75 334	0,02	
AIR WATER INC NPV*	JPY	1 000	1 300	1 300	1 000	12 363	0,00	
AISIN SEIKI CO NPV*	JPY	900	600		1 500	43 748	0,01	
AMADA CO LTD NPV*	JPY	1 800	2 200	3 900	100	855	0,00	
AOZORA BANK LTD*	JPY	600	1 100		1 700	25 797	0,01	
ASAHI INTECC CO LT NPV*	JPY	800	1 100	600	1 300	37 349	0,01	
BANDAI NAMCO HLDGS NPV*	JPY	800	1 000	400	1 400	93 717	0,03	
BENESSE HOLDINGS INC NPV*	JPY	300			300	7 065	0,00	
BK OF KYOTO NPV*	JPY	400			400	17 656	0,01	
CALBEE INC NPV*	JPY	200	700		900	27 150	0,01	
CENTRAL JAPAN RLLWY NPV*	JPY	600	600		1 200	157 649	0,05	
CHIBA BANK NPV*	JPY	4 000	4 200	4 000	4 200	21 171	0,01	
CHUGAI PHARM CO NPV*	JPY	1 100	5 900	1 900	5 100	209 350	0,07	
COCA-COLA BOTTLERS NPV*	JPY	200	1 800	1 000	1 000	15 314	0,00	990
CONCORDIA FINANZIA NPV*	JPY	7 300			7 300	23 197	0,01	
COSMOS PHARMACEUTI NPV*	JPY		100		100	15 976	0,01	
CREDIT SAISON CO NPV*	JPY		1 200	1 200				
CYBER AGENT NPV*	JPY	400	700	400	700	39 430	0,01	
DAI-ICHI LIFE HOLD NPV*	JPY	4 100	4 800		8 900	114 444	0,04	
DAICEL CORP*	JPY	2 000	2 500	2 000	2 500	16 476	0,01	
DAIFUKU CO LTD NPV*	JPY	500	300		800	73 688	0,02	
DAIICHI SANKYO COM NPV*	JPY	2 400	15 200	4 700	12 900	362 643	0,11	
DAIKIN INDUSTRIES NPV*	JPY	1 100	900	100	1 900	319 251	0,10	
DAITO TRUST CONST NPV*	JPY	300	200		500	40 570	0,01	
DAIWA HOUSE INDS NPV*	JPY	2 500	1 800		4 300	100 984	0,03	
DAIWA HOUSE REIT I REIT*	JPY	5	9		14	32 787	0,01	
DISCO CORPORATION NPV*	JPY	100	100		200	44 244	0,01	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
EISAI CO NPV*	JPY	1 100	1 000		2 100	175 222	0,06	
FANUC CORP NPV*	JPY	800	800	100	1 500	262 749	0,08	
FAST RETAILING CO NPV*	JPY	200	400	100	500	286 690	0,09	
FUJII ELECTRIC CO L NPV*	JPY	200	1 500	900	800	23 054	0,01	
FUKUOKA FINANCIAL NPV*	JPY	600	1 200	1 100	700	10 750	0,00	
GLP J-REIT REIT*	JPY		26		26	36 851	0,01	
GMO PAYMENT GATEWAY NPV*	JPY	100	700	500	300	29 357	0,01	
HANKYU HANSHIN HLD NPV*	JPY	1 400	500		1 900	55 910	0,02	
HIKARI TSUSHIN INC NPV*	JPY	100			100	21 748	0,01	
HIROSE ELECTRIC NPV*	JPY	220	200	200	220	25 914	0,01	
HISAMITSU PHARM CO NPV*	JPY	400			400	18 701	0,01	400
HITACHI CHEMICAL NPV*	JPY	600		600				
HITACHI HIGH-TECH NPV*	JPY	300	300	600				
HOSHIZAKI CORPORAT NPV*	JPY	300	200		500	36 478	0,01	
HULIC CO LTD NPV*	JPY	1 800	1 900		3 700	31 697	0,01	
IDEMITSU KOSAN CO LTD*	JPY	887	900		1 787	34 880	0,01	
IHI CORP NPV*	JPY	700		700				
ISETAN MITSUKOSHI NPV*	JPY	1 800	2 900		4 700	22 751	0,01	
ISUZU MOTORS NPV*	JPY	2 500	6 400	3 400	5 500	43 928	0,01	
ITO EN LTD NPV*	JPY		200		200	13 076	0,00	200
ITOCHU TECHNO-SOLU NPV*	JPY	700			700	24 286	0,01	
J FRONT RETAILING NPV*	JPY	800	1 800	2 600				
JAPAN AIRPORT TERM NPV*	JPY	300			300	12 093	0,00	
JAPAN EXCHANGE GP NPV*	JPY	2 100	2 200	800	3 500	89 524	0,03	
JAPAN POST INSURAN NPV*	JPY		2 600		2 600	37 372	0,01	
JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT CORP*	JPY	6	4		10	46 839	0,01	
JGC HLDGS CORP NPV*	JPY	1 200	1 900	1 700	1 400	13 261	0,00	
JSR CORP NPV*	JPY	300	1 100		1 400	30 337	0,01	
JTEKT CORPORATION NPV*	JPY	800			800	5 711	0,00	
KAJIMA CORP NPV*	JPY	2 500	1 800		4 300	47 244	0,01	
KAKAKU.COM. INC NPV*	JPY	800			800	19 272	0,01	
KAMIGUMI CO LTD NPV*	JPY	500	1 100	1 000	600	10 802	0,00	
KANEKA CORP NPV*	JPY	400		400				
KANSAI ELEC POWER NPV*	JPY	3 000	2 100		5 100	45 289	0,01	
KANSAI PAINT CO NPV*	JPY	1 100			1 100	24 976	0,01	
KAO CORP NPV*	JPY	2 100	1 900	300	3 700	254 059	0,08	
KAWASAKI HEAVY IND NPV*	JPY		2 100	1 200	900	11 103	0,00	
KEIHAN HOLDINGS CO NPV*	JPY	400	400		800	30 367	0,01	
KEIKYU CORP*	JPY	700	1 300		2 000	28 103	0,01	
KEIO CORPORATION NPV*	JPY	500	300		800	45 271	0,01	
KEISEI ELEC RY CO NPV*	JPY	500	600		1 100	28 433	0,01	
KIKKOMAN CORP NPV*	JPY	700	500		1 200	60 803	0,02	
KINTETSU GROUP HOL NPV*	JPY	700	800	400	1 100	42 951	0,01	
KIRIN HOLDINGS CO LTD NPV*	JPY	3 900	3 000		6 900	118 552	0,04	
KOBAYASHI PHARMACE NPV*	JPY	200	200		400	35 416	0,01	400
KOBE BUSSAN CO LTD NPV*	JPY		700	300	400	20 128	0,01	396
KOITO MFG CO LTD NPV*	JPY	600			600	27 946	0,01	
KOMATSU NPV*	JPY	3 900	6 700	4 100	6 500	130 721	0,04	
KOSE CORPORATION NPV*	JPY	200	200	200	200	22 375	0,01	
KURARAY CO NPV*	JPY	1 600	1 900		3 500	31 020	0,01	100
KURITA WATER INDS NPV*	JPY	100	800		900	27 111	0,01	
KYUSHU ELEC POWER NPV*	JPY	1 400	2 400		3 800	31 660	0,01	
KYUSHU RAILWAY COR NPV*	JPY	600	1 200		1 800	35 213	0,01	
LASERTEC CORP NPV*	JPY		600		600	44 975	0,01	
LION CORP NPV*	JPY	900	1 200		2 100	39 546	0,01	
M3 INC NPV*	JPY	1 600	2 000	400	3 200	181 086	0,06	
MAKITA CORP NPV*	JPY	900	800		1 700	74 297	0,02	
MARUI GROUP NPV*	JPY	400	1 200		1 600	28 013	0,01	
MCDONALD'S HOLDING NPV*	JPY	400	400	300	500	22 288	0,01	
MEBUKIFINANCIAL G NPV*	JPY	3 510			3 510	7 273	0,00	
MEIJI HOLDINGS CO NPV*	JPY	500	400		900	62 997	0,02	
MINEBEA MITSUMI INC*	JPY	2 100	1 700		3 800	65 835	0,02	
MISUMI GROUP INC NPV*	JPY	1 300	1 200		2 500	63 881	0,02	
MITSUBISHI GAS CHM NPV*	JPY	200	1 900	200	1 900	32 190	0,01	
MITSUBISHI MOTOR C NPV*	JPY	4 000			4 000	8 044	0,00	
MITSUBISHI UFJ LEA NV*	JPY	3 700			3 700	15 623	0,00	
MIYOSHI CHEMICALS NPV*	JPY	1 000			1 000	22 079	0,01	
MIYOSHI FUDOSAN CO NPV*	JPY	4 000	3 400		7 400	117 672	0,04	
MIYOSHI CO LTD NPV*	JPY		500		500	22 375	0,01	
MONOTARO CO.LTD NPV*	JPY	700	800		1 500	68 168	0,02	1 500
NABTESCO CORP NPV*	JPY	200	800		1 000	33 214	0,01	1 000
NAGOYA RAILROAD CO NPV*	JPY	700	700		1 400	35 127	0,01	
NH FOODS LTD NPV*	JPY	500	500		1 000	40 831	0,01	
NIDEC CORPORATION NPV*	JPY	1 000	4 200	1 800	3 400	290 234	0,09	
NIHON M&A CENTER I NPV*	JPY		900		900	46 856	0,01	
NIPPON BUILDING FD REIT*	JPY	6	6		12	62 266	0,02	12
NIPPON ELEC GLASS NPV*	JPY	400		400				
NIPPON EXPRESS CO NPV*	JPY	400	400		800	42 764	0,01	
NIPPON PAINT HLDGS NPV*	JPY	500	900	300	1 100	103 524	0,03	730
NIPPON SANSO HOLDI NPV*	JPY		800		800	11 248	0,00	
NIPPON SHINYAKU CO NPV*	JPY		600	200	400	30 088	0,01	
NIPPON STEEL CORP NPV*	JPY	3 949	5 000	3 400	5 549	47 803	0,02	
NISSAN CHEMICAL CO NPV*	JPY	500	600		1 100	53 629	0,02	
NISSHIN SEIFUN GRP NPV*	JPY	710	1 300		2 010	29 171	0,01	
NISSIN FOODS HLDG NPV*	JPY	400			400	34 476	0,01	
NITORI HOLDINGS CO LTD*	JPY	300	400	100	600	114 136	0,04	
NITTO DENKO CORP NPV*	JPY	700	500		1 200	71 459	0,02	
NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC*	JPY	400	2 800	1 000	2 200	38 192	0,01	
NSK LTD NPV*	JPY	1 300	2 700	2 400	1 600	11 158	0,00	
OBAYASHI CORP NPV*	JPY	3 700	2 600		6 300	52 380	0,02	
OBIC CO LTD NPV*	JPY	200	500	200	500	80 270	0,03	
ODAKYU ELEC RLWY NPV*	JPY	900	2 000		2 900	66 755	0,02	
OJI HOLDINGS CO NPV*	JPY	5 000	3 800		8 800	36 928	0,01	
OLYMPUS CORP NPV*	JPY	4 800	4 400		9 200	174 769	0,06	
ONO PHARMACEUTICAL NPV*	JPY	1 900	1 300	600	2 600	74 789	0,02	
ORACLE CORP JAPAN NPV*	JPY	300			300	29 566	0,01	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ORIENTAL LAND CO NPV*	JPY	900	1 000	400	1 500	192 491	0,06	
PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS CORP*	JPY	2 400	1 200		3 600	76 787	0,02	
PEPTIDREAM INC NPV*	JPY	500	400	400	500	21 417	0,01	
PERSOL HOLDINGS CO NPV*	JPY	700	1 400		2 100	31 135	0,01	
PIGEON CORP NPV*	JPY	400	700		1 100	45 010	0,01	1 100
POLA ORBIS HOLDINGS IN NPV*	JPY	400			400	6 906	0,00	
RAKUTEN INC NPV*	JPY	3 400	5 200	2 300	6 300	62 088	0,02	6 300
RECRUIT HLDGS CO L NPV*	JPY	5 500	5 700	1 600	9 600	347 685	0,11	
RINNAI CORP NPV*	JPY	200	200		400	35 695	0,01	
RYOHIN KEIKAKU CO NPV*	JPY	1 000	3 500	2 200	2 300	34 842	0,01	
SANKYO CO LTD NPV*	JPY	200		200				
SBI HOLDINGS INC NPV*	JPY	1 300			1 300	30 705	0,01	
SCSK CORP*	JPY		300		300	15 331	0,00	
SECOM CO NPV*	JPY	800	1 000	300	1 500	125 446	0,04	
SEIBU HOLDINGS INC NPV*	JPY	1 000	1 400		2 400	23 611	0,01	
SEKISUI HOUSE NPV*	JPY	3 000	3 000		6 000	97 029	0,03	
SEVEN BANK NPV*	JPY	3 400			3 400	7 548	0,00	
SHARP CORP NPV*	JPY	600	4 700	2 400	2 900	32 771	0,01	
SHIMANO INC NPV*	JPY	300	300		600	108 234	0,03	
SHIMIZU CORP NPV*	JPY	3 000	2 900		5 900	40 528	0,01	
SHIN-ETSU CHEMICAL NPV*	JPY	1 500	1 400	200	2 700	321 684	0,10	
SHINSEI BANK NPV*	JPY	800	1 500	1 400	900	10 139	0,00	
SHIONOGI & CO NPV*	JPY	1 200	1 200	400	2 000	98 013	0,03	
SHISEIDO CO LTD NPV*	JPY	1 700	2 000	600	3 100	162 877	0,05	
SHIZUOKA BANK NPV*	JPY	3 000			3 000	18 962	0,01	
SHOWA DENKO KK NPV*	JPY	700	800	800	700	11 713	0,00	
SMC CORP NPV*	JPY	200	400	100	500	254 478	0,08	
SONY FINANCIAL HOL NPV*	JPY	900		900				
SQUARE-ENIX HOLDIN NPV*	JPY		1 000	400	600	36 356	0,01	
STANLEY ELECTRIC NPV*	JPY	700	1 100	800	1 000	26 249	0,01	
SUMITOMO HEAVY IND NPV*	JPY	600	2 300	1 400	1 500	31 890	0,01	
SUMITOMO METAL MNG NPV*	JPY	800	1 600		2 400	67 803	0,02	
SUMITOMO RUBBER NPV*	JPY	900			900	7 624	0,00	891
SUNDRUG CO LTD NPV*	JPY	200			200	6 904	0,00	
SUNTORY BEVERAGE & NPV*	JPY	600			600	20 633	0,01	
SUZUKEN CO LTD NPV*	JPY	330	500	500	330	11 506	0,00	
SUZUKI MOTOR CORP NPV*	JPY	1 700	1 200		2 900	113 185	0,04	
SYSMEX CORP NPV*	JPY	600	1 200	200	1 600	139 715	0,04	
T&D HOLDINGS INC NPV*	JPY	2 800	4 200	3 700	3 300	29 649	0,01	
TAIHEIYO CEMENT NPV*	JPY		800		800	18 624	0,01	
TAISEI CORP NPV*	JPY	1 200	600		1 800	55 632	0,02	
TAISHO PHARM H NPV*	JPY	200			200	12 049	0,00	
TEIJIN LTD NPV*	JPY	500	1 800		2 300	32 619	0,01	
TERUMO CORP NPV*	JPY	2 400	2 800		5 200	189 235	0,06	
THK CO LTD NPV*	JPY	700	800	800	700	16 022	0,01	
TIS INC. NPV*	JPY		1 600		1 600	31 035	0,01	
TOBU RAILWAY CO NPV*	JPY	1 200	500		1 700	48 027	0,02	
TOHO CO LTD NPV*	JPY	400	600		1 000	37 741	0,01	600
TOHO GAS CO NPV*	JPY	400			400	18 178	0,01	
TOHOKU ELEC POWER NPV*	JPY	1 700	1 900		3 600	33 097	0,01	
TOKYO GAS CO NPV*	JPY	1 500	1 600		3 100	64 935	0,02	
TOKYU CORP NPV*	JPY	2 300	2 800	1 500	3 600	42 719	0,01	
TORAY INDS INC NPV*	JPY	5 400	7 500		12 900	53 829	0,02	
TOSOH CORP NPV*	JPY	600	1 500		2 100	31 172	0,01	
TOTO LTD NPV*	JPY	500	1 400	500	1 400	58 809	0,02	
TOYO SUISAN KAISHA NPV*	JPY	500	600		1 100	53 246	0,02	
TOYODA GOSEI NPV*	JPY	300	900		1 200	25 126	0,01	
TOYOTA INDUSTRIES NPV*	JPY	700	400		1 100	63 589	0,02	
TOYOTA TSUSHO CORP NPV*	JPY	1 200	800	700	1 300	33 297	0,01	
TSURUHA HOLDINGS I NPV*	JPY	100	200		300	38 942	0,01	
USS CO LTD NPV*	JPY	500	1 600		2 100	34 353	0,01	
WELCIA HOLDINGS CO NPV*	JPY		1 200	400	800	32 212	0,01	
YAKULT HONSHA CO NPV*	JPY	500	500		1 000	50 930	0,02	
YAMAHA CORP NPV*	JPY	800			800	34 964	0,01	
YAMATO HOLDINGS CO NPV*	JPY	1 200	1 400		2 600	62 497	0,02	
ZOZO INC NPV*	JPY	900	500	740	660	16 824	0,01	
Total Japan						10 838 818	3,43	
Luxemburg								
RTL GROUP NPV*	EUR	115		115				
Total Luxemburg							0,00	
Macau								
SANDS CHINA LTD USD0.01 REG'S*	HKD	10 400	4 800		15 200	53 788	0,02	
WYNN MACAU LTD HKD0.10*	HKD	3 200	19 200		22 400	32 822	0,01	16 400
Total Macau						86 610	0,03	
Niederlande								
AERCAP HOLDINGS EURO.01*	USD	635	1 132	585	1 182	27 355	0,01	1 182
AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)*	EUR	963	813	208	1 568	145 991	0,05	
ALTICE EUROPE N.V. EURO.01 (COMMON SHARES A)*	EUR		7 958	4 412	3 546	15 633	0,00	3 546
ARGEN X NV EURO.10*	EUR		328		328	79 510	0,03	144
EXOR NV EURO.01*	EUR	563	673	251	985	49 325	0,02	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6*	EUR	629	254		883	63 215	0,02	
HEINEKEN NV EUR1.60*	EUR	1 158	993	195	1 956	159 905	0,05	1 956
ING GROEP N.V. EURO.01*	EUR	16 568	16 976	4 184	29 360	191 593	0,06	
JUST EAT TAKEAWAY EURO.04*	EUR		1 505	520	985	101 622	0,03	985
KON KPN NV EURO.04*	EUR	13 390	24 923	8 183	30 130	65 150	0,02	
KONINKLIJKE AHOLD EURO.01*	EUR	5 067	4 297	693	8 671	235 883	0,07	
KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20*	EUR	4 071	4 895	1 375	7 591	328 769	0,10	
NXP SEMICONDUCTORS EURO.20*	EUR	1 192			1 192	136 950	0,04	
NXP SEMICONDUCTORS EURO.20*	USD	29	1 131	227	933	106 986	0,03	
RANDSTAD N.V. EURO.10*	EUR	458	849	416	891	42 746	0,01	
UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)*	EUR	357	1 627	411	1 573	53 383	0,02	1 573
UNILEVER EURO.16*	EUR	6 217	6 714	1 171	11 760	652 500	0,21	
VOPAK(KON) EURO.50*	EUR	343	451	336	458	23 715	0,01	
WOLTERS KLUWER EURO.12*	EUR	1 179	1 986	1 035	2 130	167 153	0,05	
Total Niederlande						2 647 384	0,84	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ² in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Neuseeland								
AUCKLAND INTL NPV*	NZD	2 927	19 944	7 978	14 893	65 889	0,02	
FISHER & PAYKEL HE NPV*	NZD	2 072	2 778		4 850	97 993	0,03	
FLETCHER BUILDING NPV*	NZD	5 237	6 977	12 214				
MERCURY NZ LTD NPV*	NZD		6 448		6 448	19 971	0,01	
MERIDIAN ENERGY LT NPV*	NZD	7 833			7 833	23 547	0,01	
RYMAN HEALTHCARE G NPV*	NZD	3 102	2 466	2 608	2 960	25 310	0,01	
SPARK NEW ZEALAND NPV*	NZD	11 777	6 880		18 657	53 252	0,02	
THE A2 MILK CO LTD NPV*	NZD	2 471	3 527		5 998	55 877	0,02	5 998
Total Neuseeland						341 838	0,11	
Norwegen								
GJENSIDIGE FORSIKR NOK2*	NOK	914	2 745	1 944	1 715	31 895	0,01	
ORKLA ASA NOK1.25*	NOK	3 613	4 653	2 586	5 680	52 639	0,02	
SCHIBSTED ASA SER'B/NOK0.5*	NOK	584	926		1 510	55 305	0,02	584
YARA INTERNATIONAL NOK1.7*	NOK	646	1 397		2 043	72 118	0,02	2 043
Total Norwegen						211 958	0,07	
Singapur								
CAPITALAND SGD1*	SGD	14 000	607		14 607	26 642	0,01	
CITY DEVELOPMENTS SGDO.50*	SGD	100	6 100	3 000	3 200	16 390	0,01	
COMFORTDELGRO CORP SGDO.25*	SGD	11 300		11 300				
DAIRY FARM INTL ORD USDO.055555 (BERM REG)*	USD	1 300			1 300	4 503	0,00	1 300
DBS GROUP HLDGS SGD1*	SGD	8 049	7 500	1 200	14 349	192 276	0,06	
GOLDEN AGRI RESOUR USDO.025*	SGD	35 000		35 000				
JARDINE CYCLE & CA SGD1*	SGD	422	1 400	1 822				
KEPPEL CORP NPV*	SGD	4 500	9 400		13 900	41 630	0,01	
MAPLE TREE LOGISTICS TRUST-UNITS REIT*	SGD		9 700		9 700	13 318	0,00	
OVERSEA-CHINESE BK NPV*	SGD	13 235	14 845		28 080	159 126	0,05	
SATS LTD NPV*	SGD	6 500		6 500				
SEBICORP INDUSTRIE SGDO.25 (POST REORG)*	SGD	10 000		10 000				
SINGAPORE AIRLINES NPV*	SGD	4 200	9 000	4 200	9 000	21 019	0,01	
SINGAPORE EXCHANGE SGDO.01*	SGD	3 000	4 300		7 300	44 955	0,01	5 041
SINGAPORE PRESS HD SGDO.20*	SGD	8 000		8 000				
SINGAPORE TECH ENG NPV*	SGD	10 800			10 800	25 150	0,01	
SUNTEC REIT NPV (REIT)*	SGD	18 000			18 000	17 566	0,01	18 000
UOL GROUP LIMITED SGD1*	SGD	1 025	4 800		5 825	26 071	0,01	
UTD O/S BANK SGD1*	SGD	4 494	6 700	1 300	9 894	126 720	0,04	
VENTURE CORP LTD SGDO.25*	SGD	1 400	2 100	1 600	1 900	24 603	0,01	1 900
WILMAR INTERNATIONAL LTD*	SGD	8 000	7 100		15 100	44 716	0,01	
Total Singapur						784 683	0,25	
Südkorea								
LINE CORP NPV*	JPY		500		500	23 332	0,01	
Total Südkorea						23 332	0,01	
Spanien								
ACS ACTIVIDADES CO EURO.5*	EUR	1 226	771		1 997	41 664	0,01	1 997
AENA SME S.A. EUR10*	EUR	222	421	131	512	65 808	0,02	
AMADEUS IT GROUP EURO.01*	EUR	1 785	1 884	337	3 332	170 839	0,05	3 332
BANKIA S.A. EUR1 (POST CONS)*	EUR	6 807		6 807				
BCO DE SABADELL EURO.125*	EUR	23 431	30 501	53 932				
CAIXABANK SA EUR1*	EUR	19 036	33 310	15 183	37 163	72 590	0,02	37 163
CELLNEX TELECOM SA EURO.25*	EUR	1 088	1 997	308	2 777	155 577	0,05	2 202
ENAGAS SA EUR1.50*	EUR	1 022	940		1 962	41 631	0,01	1 962
ENDESA SA EUR1.2*	EUR	1 244	1 523		2 767	68 058	0,02	
FERROVIAL SA EURO.2*	EUR	2 118	3 419	902	4 635	103 618	0,03	
GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD*	EUR	986	2 232	704	2 514	66 602	0,02	2 514
IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)*	EUR	25 546	26 030	5 682	45 894	519 666	0,16	
INDITEX EURO.03 (POST SUBD)*	EUR	4 892	4 272	799	8 365	214 491	0,07	
NATURGY ENERGY GRO EUR1*	EUR	1 053	1 846	992	1 907	35 174	0,01	1 907
RED ELECTRICA CORP EURO.5*	EUR	1 196	2 168		3 364	58 043	0,02	3 364
REPSOL SA EUR1*	EUR	6 876	6 857	2 799	10 934	67 405	0,02	10 934
SIEMENS GAMESA REN EURO.17*	EUR	619	1 208		1 827	45 449	0,01	1 825
TELEFONICA SA EUR1*	EUR	21 716	27 445	4 487	44 674	141 359	0,04	42 379
Total Spanien						1 867 974	0,59	
Schweden								
ASSA ABLOY SER'B/NPV (POST SPLIT)*	SEK	4 043	6 084	1 240	8 887	191 671	0,06	8 887
ESSITY AB SER'B/NPV*	SEK	2 911	3 530	1 004	5 437	169 001	0,05	5 437
HUSQVARNA AB SER'B/NPV*	SEK	1 238	3 849	2 295	2 792	28 294	0,01	2 792
ICA GRUPPEN AB*	SEK	144	1 126		1 270	59 358	0,02	1 270
INDUSTRIVARDEN AB SER'C/NPV*	SEK	976	902	821	1 057	25 922	0,01	13
LATOUR INVESTMENT SER'B/NPV (POST SPLIT)*	SEK		1 085		1 085	23 479	0,01	1 085
LUNDBERGFÖRETAGEN SER'B/NPV*	SEK	670			670	30 551	0,01	670
LUNDIN ENERGY AB NPV*	SEK	588	1 499	759	1 328	24 334	0,01	
NIBE INDUSTRIER AB NPV B(POST SPLIT)*	SEK		3 451	1 239	2 212	52 476	0,02	2 212
SECURITAS SER'B/NPV*	SEK	1 578	1 532		3 110	43 817	0,01	3 110
SKANSKA AB SER'B/NPV*	SEK	1 319	3 364	936	3 747	73 005	0,02	3 747
SVENSKA CELLULOSA SER'B/NPV*	SEK		5 496		5 496	69 423	0,02	5 496
SVENSKA HANDELSBKN SER'A/NPV (P/S)*	SEK	6 815	5 860		12 675	98 001	0,03	12 675
TELIA COMPANY AB NPV*	SEK	11 475	11 172		22 647	85 669	0,03	22 647
Total Schweden						975 000	0,31	
Schweiz								
GLENCORE XSTRATA ORD USDO.01*	USD	43 457			43 457	83 246	0,03	
GLENCORE XSTRATA ORD USDO.01*	GBP	4 286	39 449	8 974	34 761	66 457	0,02	
Total Schweiz						149 703	0,05	
Grossbritannien								
3I GROUP ORD GBPO.738636*	GBP	3 868	4 833		8 701	102 996	0,03	
ASTRAZENECA ORD USDO.25*	GBP	5 729	6 019	1 428	10 320	1 036 632	0,33	
AVEVA GROUP ORD GBPO.035556*	GBP		550		550	31 265	0,01	
AVIVA ORD GBPO.25*	GBP	14 524	18 364	5 797	27 091	91 931	0,03	
BAE SYSTEMS ORD GBPO.025*	GBP	13 774	12 600		26 374	150 991	0,05	
BARRATT DEVEL ORD GBPO.10*	GBP	5 842	4 358	2 883	7 317	41 351	0,01	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25*	GBP	9 889	10 415	1 849	18 455	608 831	0,19	
BRITISH LAND CO PLC REIT*	GBP	3 455	4 215		7 670	30 738	0,01	
BT GROUP ORD GBP0.05*	GBP	38 897	24 628		63 525	74 230	0,02	
BUNZL ORD GBP0.32142857*	GBP	1 506	912		2 418	72 001	0,02	
COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01*	EUR	695		540	155	5 603	0,00	155
COCA-COLA EUROPEAN ORD EURO.01*	USD	332	1 038		1 370	48 850	0,02	
EVRAZ PLC ORD USD1*	GBP	1 466	4 645		6 111	25 012	0,01	
FRESNILLO PLC ORD USD0.50*	USD	970		970				
HALMA ORD GBP0.10*	GBP	1 841	1 135		2 976	82 890	0,03	
HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10*	GBP		1 467		1 467	45 199	0,01	
INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001*	GBP	6 286	7 559	3 079	10 766	48 145	0,02	
ITV ORD GBP0.10*	GBP	9 710	30 481	40 191				
JD SPORTS FASHION ORD GBP0.0025*	GBP		4 565		4 565	43 887	0,01	
JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245*	GBP	812			812	22 732	0,01	
KINGFISHER ORD GBP0.157142857*	GBP	7 743	17 243		24 986	88 053	0,03	
LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666*	GBP	3 078	3 219		6 297	39 079	0,01	
LIBERTY GLOBAL INC USD0.01 A*	USD	528	806		1 334	25 750	0,01	
LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1*	GBP	282 552	313 048	71 497	524 103	164 062	0,05	
MARKS & SPENCER GP ORD GBP0.25*	GBP	10 237		10 237				
MEGGITT ORD GBP0.05*	GBP	2 005	2 928	4 933				
MELROSE INDUST PLC ORD GBP0.0685714*	GBP	19 191	18 778		37 969	52 088	0,02	
MERLIN ENTERTAINME ORD GBP0.01 (WI)*	GBP	1 763		1 763				
NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289*	GBP	14 925	13 147	1 533	26 539	280 482	0,09	
OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02*	GBP	2 034	1 505		3 539	115 344	0,04	
RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10*	GBP	3 136	2 675	406	5 405	485 340	0,15	
RELX PLC GBP0.1444*	GBP	5 659	8 193		13 852	283 976	0,09	
RELX PLC GBP0.1444*	EUR	2 986		2 276	710	14 557	0,00	
RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01*	GBP	7 556	7 453		15 009	95 482	0,03	
ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20*	GBP	6 626	6 222		12 848	19 838	0,01	
ROYAL DUTCH SHELL 'B'SHS EURO.07 (UK LIST)*	EUR	16 060			16 060	179 255	0,06	
ROYAL DUTCH SHELL 'B'SHS EURO.07 (UK LIST)*	GBP	263	13 763	1 630	12 396	138 430	0,04	
SAGE GROUP GBP0.01051948*	GBP	4 384	3 065		7 449	63 774	0,02	
SEVERN TRENT ORD GBP0.9789*	GBP	1 379	650		2 029	58 779	0,02	
SMITHS GROUP ORD GBP0.375*	GBP	1 680	1 796		3 476	56 769	0,02	
SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769*	GBP	347	243		590	77 541	0,02	
SSE PLC ORD GBP0.50*	GBP	4 370	4 272	1 090	7 552	108 357	0,03	
ST JAMES'S PLACE ORD GBP0.15*	GBP	1 472	3 237		4 709	52 072	0,02	
UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05*	GBP	2 825	3 728		6 553	66 610	0,02	
WEIR GROUP ORD GBP0.125*	GBP	632	1 079	1 711				
WHITBREAD ORD GBP0.76797385*	GBP	477	753		1 230	31 045	0,01	
WOOD GROUP (JOHN) ORD GBP0.0428571(POST CONS)*	GBP	4 023		4 023				
WPP PLC ORD GBP0.10*	GBP	6 345	4 895	2 334	8 906	64 315	0,02	
Total Grossbritannien						5 124 285	1,62	

Vereinigte Staaten

3M CO COM*	USD	2 474	2 443	524	4 393	646 497	0,20	
AFLAC INC COM USD0.10*	USD	3 199	3 100	1 119	5 180	172 994	0,05	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM*	USD	740	966	457	1 249	126 847	0,04	1 249
ALBEMARLE CORP COM USD0.01*	USD	493	397		890	73 003	0,02	890
ALIGN TECHNOLOGY INC COM*	USD	350	386	106	630	189 480	0,06	79
ALKERMES PLC COM USD0.01*	USD	1 000		1 000				
ALLEGHANY CORP DEL COM*	USD	74			74	35 384	0,01	
ALLIANCE DATA SYST COM USD0.01*	USD	211		211				
ALLIANT ENERGY CORP COM*	USD	1 074	1 454	462	2 066	98 039	0,03	2 066
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC COM*	USD	400	520		920	123 068	0,04	402
ALPHABET INC CAP STK USD0.001 CL C*	USD	1 352	1 276	249	2 379	3 212 114	1,02	
ALTICE USA INC COM USD0.01 CL A*	USD	400	2 236		2 636	62 967	0,02	
AMER ELEC PWR INC COM USD6.50*	USD	2 256	2 016	509	3 763	282 562	0,09	3 414
AMERICAN AIRLINES COM USD1*	USD	28	572	600				
AMERICAN WATER WOR COM STK USD0.01*	USD	799	787	205	1 381	183 823	0,06	459
ANSYS INC COM*	USD	406	288		694	208 646	0,07	
AQUA AMERICA INC COM USD0.50*	USD		1 335	1 335				
ARISTA NETWORKS IN COM USD0.0001*	USD	240	225		465	88 404	0,03	465
ARROW ELECTRS INC COM*	USD	300	528		828	59 839	0,02	
BAKER HUGHES COMPA COM USD0.0001 CL A*	USD	2 295	3 504	1 209	4 590	56 045	0,02	3 163
BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20*	USD	769	1 045	733	1 081	60 732	0,02	100
BERKSHIRE HATHAWAY CLASS'B' COM USD0.0033*	USD	5 583	7 508	2 039	11 052	2 162 198	0,68	
BIO RAD LABS INC CL A*	USD		158		158	74 825	0,02	
BIOMARIN PHARMA COM USD0.001*	USD	904	603	162	1 345	94 013	0,03	
BLACK KNIGHT INC COM USD0.0001 WI*	USD		1 438	373	1 065	85 176	0,03	1 065
BLACKROCK INC COM STK USD0.01*	USD	529	802	159	1 172	606 817	0,19	1 172
BLOCK(H&R)INC COM NPV*	USD	763		763				
BOOZ ALLEN HAMILTO COM USD0.01 CLASS 'A'*	USD		1 236	257	979	74 637	0,02	
BOSTON PPTY INC COM USD0.01*	USD	667	413		1 080	79 678	0,03	395
BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01*	USD	6 119	6 665	1 210	11 574	406 310	0,13	
BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01*	USD	532	451	149	834	101 143	0,03	
BROWN & BROWN INC COM*	USD		2 210	448	1 762	73 285	0,02	
BROWN FORMAN CORP CL B*	USD	1 339	1 566	587	2 318	160 406	0,05	2 318
CABLE ONE INC COM USD1 'WI'*	USD		23		23	39 841	0,01	
CABOT OIL & GAS CO COM USD0.10*	USD	1 823	3 259	1 763	3 319	52 936	0,02	3 319
CADENCE DESIGN SYS COM USD0.01*	USD	1 258	1 946	842	2 362	231 396	0,07	
CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375*	USD	526	971		1 497	66 527	0,02	1 497
CATALENT INC COM USD0.01*	USD		1 272		1 272	100 107	0,03	1 272
CDK GLOBAL INC COM USD0.01*	USD	459	924	451	932	37 325	0,01	
CDW CORP COM USD0.01*	USD	563	711	220	1 054	115 748	0,04	448
CERNER CORP COM*	USD	1 273	1 394	386	2 281	151 496	0,05	
CHENIERE ENERGY INC COM NEW*	USD	880	2 108	568	2 420	102 876	0,03	
CIMAREX ENERGY CO COM USD0.01*	USD	342		342				
CINCINNATI FINL CORP COM*	USD	625	731		1 060	75 933	0,02	1 060
CINTAS CORP COM*	USD	370	472	170	672	205 489	0,06	672
CLOROX CO DEL COM*	USD	531	681	280	932	179 963	0,06	932
CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS'A'*	USD	1 548	1 523	333	2 738	420 875	0,13	
CMS ENERGY CORP COM*	USD	982	2 216	634	2 564	144 662	0,05	
COCA-COLA CO COM USD0.25*	USD	17 436	19 046	4 533	31 949	1 449 165	0,46	
COGNEX CORP COM*	USD	602	1 394	519	1 477	88 340	0,03	
COLGATE-PALMOLIVE COM USD1*	USD	3 464	3 819	679	6 604	468 102	0,15	1 153
CONSTELLATION BRDS CLASS'A' COM USD0.01*	USD	693	707	119	1 281	223 038	0,07	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
COPART INC COM*	USD	884	889	219	1 554	150 141	0,05	
COSTAR GROUP INC COM*	USD	171	125		296	230 752	0,07	
COTY INC COM USD0.01 CL 'A'*	USD	1 093	4 825	5 918				
COUPA SOFTWARE INC COM USD0.0001*	USD		646	134	512	129 003	0,04	512
CSX CORP COM USD1*	USD	3 431	3 031	560	5 902	421 163	0,13	
DEERE & CO COM USD1*	USD	1 277	1 224	220	2 281	464 463	0,15	2 281
DEVON ENERGY CORP NEW COM*	USD	1 544	966	2 510				
DEXCOM INC COM*	USD	366	394	66	694	262 843	0,08	
DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01*	USD	858	1 338	200	1 996	269 132	0,09	
DISCOVERY INC COM USD0.01 SER A*	USD	968			968	19 361	0,01	968
DISCOVERY INC COM USD0.01 SER C*	USD	1 471	1 943	934	2 480	44 659	0,01	
DOMINION ENERGY IN COM STK NPV*	USD	3 424	3 921	575	6 770	490 940	0,16	6 770
DROPBOX INC COM USD0.00001 CL A*	USD	800	976		1 776	31 427	0,01	
DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)*	USD	3 132	3 225	740	5 617	457 024	0,14	
ECOLAB INC COM*	USD	1 109	1 086	254	1 941	356 373	0,11	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM*	USD	891	6 065	1 739	5 217	382 587	0,12	5 217
EOG RESOURCES INC COM USD0.01*	USD	2 572	2 597	705	4 464	147 401	0,05	
EPAM SYS INC COM USD0.001*	USD	219	224		443	131 577	0,04	
EQUIFAX INC COM*	USD	517	513	121	909	131 034	0,04	909
EQUITY LIFESTYLE PPTYS INC*	USD	308	1 492	308	1 492	84 029	0,03	
EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01*	USD	1 621	1 526	517	2 630	124 029	0,04	
ERIE INDY CO CL A*	USD	85	109		194	37 480	0,01	85
ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001*	USD	281	265		546	100 724	0,03	
EXACT SCIENCES CORP COM*	USD	610	622		1 232	115 397	0,04	1 232
EXPEDITRS INTL WASH COM USD0.01*	USD	685	804	304	1 185	98 551	0,03	1 185
F M C CORP COM NEW*	USD	521	582	185	918	89 326	0,03	
F5 NETWORK INC COM STK NPV*	USD	290	475	301	464	52 337	0,02	464
FACTSET RESH SYS INC COM*	USD	133	171		304	93 532	0,03	304
FAIR ISAAC CORP COM*	USD		258		258	100 831	0,03	
FASTENAL COM USD0.01*	USD	2 254	3 673	743	5 184	214 755	0,07	5 184
FIDELITY NATL FINL FNF GROUP COM USD0.0001*	USD	1 234	1 039	440	1 833	52 728	0,02	
FLEX LTD COM USD0.01*	USD	1 392	1 508	2 900				
FLIR SYS INC COM*	USD	735	580		1 315	43 312	0,01	
FLOWERVE CORP COM*	USD	800		800				
FORTINET INC COM USD0.001*	USD	750	459		1 209	130 860	0,04	
FORTIVE CORP COM USD0.01*	USD	1 269	1 358	361	2 266	158 661	0,05	
FRANKLIN RES INC COM*	USD	1 467	1 178		2 645	49 452	0,02	2 645
GALLAGHER ARTHUR J & CO COM*	USD	741	1 293	242	1 792	173 827	0,05	
GAP INC DEL COM*	USD	1 033	1 844	2 877				
GARTNER INC COM*	USD	374	395		769	88 280	0,03	
GEN DYNAMICS CORP COM USD1*	USD	1 076	1 036	229	1 883	239 485	0,08	
GEN ELEC CO COM USD0.06*	USD	37 768	34 654	5 336	67 086	383 988	0,12	55 004
GRUBHUB INC COM USD0.0001*	USD	464		464				
GUIDEWIRE SOFTWARE COM USD0.0001*	USD		755		755	72 328	0,02	755
HANESBRANDS INC COM*	USD	1 378	2 140	3 518				
HARLEY DAVIDSON INC COM*	USD	799	525	1 324				
HEICO CORP NEW CL A*	USD	354	273		627	51 073	0,02	627
HEICO CORP NEW COM*	USD	235			235	22 597	0,01	235
HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01*	USD	361	491	222	630	94 109	0,03	630
HONEYWELL INTL INC COM USD1*	USD	3 099	2 868	5 967				
HUNT J B TRANS SVCS INC COM*	USD	329	501	158	672	78 027	0,02	672
IDEX CORP COM*	USD	356	215		571	95 693	0,03	
IDEXX LABORATORIES COM USD0.10*	USD	372	335	57	650	234 760	0,07	
IHS MARKIT LTD COM*	USD	1 575	2 139	470	3 244	233 993	0,07	
ILLINOIS TOOL WKS COM NPV*	USD	1 364	1 466	404	2 426	430 643	0,14	
ILLUMINA INC COM USD0.01*	USD	632	587	90	1 129	320 599	0,10	
INCYTE CORPORATION COM USD0.001*	USD	766	1 016	415	1 367	112 707	0,04	
INSULET CORP COM STK USD0.001*	USD		510		510	110 857	0,04	510
INTERCONTINENTAL E COM USD0.01*	USD	2 352	2 297	457	4 192	385 333	0,12	
INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM*	USD	362	762	549	575	64 688	0,02	575
INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM*	ILS	56			56	6 363	0,00	
INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10*	USD	1 416	3 430	2 479	2 367	36 252	0,01	
INTUITIVE SURGICAL COM USD0.001*	USD	505	516	126	895	583 441	0,18	
INVITATION HOMES I COM USD0.01*	USD	1 728	4 195	798	5 125	131 794	0,04	5 125
IONIS PHARMACEUTIC COM USD0.001*	USD	563	739	313	989	43 115	0,01	
IPG PHOTONICS CORP COM USD0.0001*	USD	200	125		325	50 752	0,02	325
JOHNSON & JOHNSON COM USD1*	USD	11 426	12 472	3 045	20 853	2 852 346	0,90	
JP MORGAN CHASE & CO COM USD1*	USD	13 949	14 456	4 480	23 925	2 116 120	0,67	
JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001*	USD	1 643	1 375	856	2 162	42 706	0,01	
KRAFT HEINZ CO COM USD0.01*	USD	3 094	3 433	1 360	5 167	142 178	0,04	323
LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI*	USD	656	616	282	990	60 277	0,02	2
LEGGITT & PLATT IN COM USD0.01*	USD	405	473	878				
LEIDOS HLDGS INC COM USD0.0001*	USD	507	597	1 104				
LENNOX INTL INC COM*	USD	134	183		317	79 396	0,03	206
LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'A'*	USD		496	196	300	39 086	0,01	300
LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'C'*	USD	430	427		857	112 491	0,04	
LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER A SIRIUSXM*	USD	184	509		693	21 119	0,01	
LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM*	USD	900	775	530	1 145	34 799	0,01	
LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C FORMULA*	USD	771	906		1 677	55 883	0,02	
LIVE NATION INC COM*	USD	766	506		1 272	62 967	0,02	1 272
LOEWS CORP COM*	USD	1 064	912		1 976	63 087	0,02	
LYONDELLBASELL IND COM USD0.01*	USD	1 154	1 615	735	2 034	131 727	0,04	
M & T BANK CORP COM USD0.50*	USD	532	430		962	81 393	0,03	
MACERICH CO COM USD0.01*	USD	644		644				
MARKEL CORP COM*	USD	67	37		104	93 037	0,03	
MARKETAXESS HLDGS INC COM*	USD	189	120		309	136 720	0,04	
MARSH & MCLENNAN COM USD1*	USD	2 132	2 099	399	3 832	403 819	0,13	
MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01*	USD	245	337	106	476	102 929	0,03	
MARVELL TECH GROUP COM USD0.002*	USD	2 591	4 682	1 967	5 306	193 533	0,06	1 942
MASIMO CORPORATION COM STK USD0.001*	USD		392		392	85 017	0,03	392
MATCH GROUP INC COM USD0.001*	USD		600	600				
MAXIM INTEGRATED COM USD0.001*	USD	1 371	2 473	1 815	2 029	126 035	0,04	
MEDICAL PROP TST COM USD0.001*	USD		4 034		4 034	65 341	0,02	4 034
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM*	USD	107	88		195	173 020	0,05	195
MOLINA HEALTHCARE INC COM*	USD		508		508	85 429	0,03	508
MONGODB INC COM USD0.001 CL A*	USD	200	239	99	340	72 318	0,02	340

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ² in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MONSTER BEV CORP USD0.005(NEW)*	USD	1 807	1 965	732	3 040	223 999	0,07	
MOODY'S CORP COM USD0.01*	USD	768	639	124	1 283	341 663	0,11	
MYLAN NV EURO.01*	EUR	2 200		851	1 349	17 635	0,01	
MYLAN NV EURO.01*	USD	393	3 033	1 128	2 298	31 310	0,01	2 298
NASDAQ INC COM STK USD0.01*	USD	485	484	155	814	91 770	0,03	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC COM*	USD		998	314	684	60 429	0,02	
NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL'A*	USD	871	3 129	1 552	2 448	31 532	0,01	
NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01*	USD	2 069	2 235	423	3 881	989 687	0,31	
NORDSON CORP COM*	USD		379		379	66 793	0,02	
NORDSTROM INC COM NPV*	USD	600		600				
OKTA INC COM USD0.0001 CL A*	USD	400	496		896	176 041	0,06	896
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC*	USD		2 005		2 005	55 152	0,02	
PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01*	USD	202	200	58	344	98 386	0,03	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC COM STK USD0.01*	USD	1 504	3 289		4 793	45 401	0,01	1 853
PEPSICO INC CAP USD0.016666*	USD	6 032	6 016	1 168	10 880	1 385 446	0,44	
PERKINELMER INC COM USD1*	USD	415	570		985	113 583	0,04	985
PHILIP MORRIS INTL COM STK NPV 'WI'*	USD	6 720	7 345	1 738	12 327	849 294	0,27	2 015
PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01*	USD	746	785	249	1 282	101 282	0,03	
POLARIS INC COM USD0.01*	USD	229		229				
PPG INDS INC COM*	USD	1 117	1 216	550	1 783	199 983	0,06	
PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1*	USD	2 380	3 015	464	4 931	428 889	0,14	
PTC INC COM USD0.01*	USD	485	562	235	812	61 711	0,02	
PUBLIC STORAGE COM USD0.10*	USD	660	668	129	1 199	245 344	0,08	1 199
PULTE GROUP INC COM USD0.01*	USD	1 226	629		1 855	78 891	0,02	
QIAGEN NV EURO.01*	EUR	884	3 082	1 983	1 983	94 644	0,03	1 983
QORVO INC COM USD 0.0001*	USD	538	427		965	114 379	0,04	
RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01*	USD	228	206		434	27 102	0,01	434
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP*	USD	3 500	1 946	5 446				
REALTY INCOME CORP*	USD	1 322	2 080	421	2 981	166 382	0,05	2 981
RESMED INC COM USD0.004*	USD	722	672	339	1 055	166 164	0,05	
RINGCENTRAL INC COM USD0.0001 CL'A*	USD		750	204	546	137 755	0,04	
ROKU INC COM USD0.0001 CLASS A*	USD	300	711	143	868	150 563	0,05	868
ROLLINS INC COM*	USD	386	1 136	479	1 043	51 928	0,02	1 043
ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01*	USD	454	410		864	313 638	0,10	
RPM INTERNATIONAL COM USD0.01*	USD		1 568	584	984	74 892	0,02	600
S&P GLOBAL INC COM USD1*	USD	1 120	1 103	271	1 952	646 700	0,20	
SABRE CORP COM USD0.01*	USD	879	860	1 739				
SAREPTA THERA INC COM USD0.0001*	USD	234	390		624	80 509	0,03	624
SEAGATE TECH PLC COM USD0.00001*	USD	935	856		1 791	81 073	0,03	1 721
SEATTLE GENETICS I COM USD0.001*	USD	600	398	109	889	159 833	0,05	
SEMPRA ENERGY COM NPV*	USD	1 150	1 209	155	2 204	239 670	0,08	1 286
SHERWIN-WILLIAMS COM USD1*	USD	376	318	54	640	409 683	0,13	
SMITH A O COM*	USD	644	306		950	46 085	0,01	50
SNAP INC COM USD0.00001 CL A*	USD	3 100	4 609	1 166	6 543	156 957	0,05	4 730
SOUTHERN CO COM*	USD	4 434	5 630	1 822	8 242	410 572	0,13	
SPLUNK INC COM USD0.001*	USD	688	591	97	1 182	204 302	0,06	
SPRINT CORPORATION COM USD0.01*	USD	2 729	4 587	7 316				
SS&C TECH HLDGS COM USD0.01*	USD	1 000	1 272	640	1 632	90 744	0,03	
STRYKER CORP COM USD0.10*	USD	1 509	1 316	253	2 572	492 384	0,16	2 572
SUN COMMUNITIES COM USD0.01*	USD	292	499		791	102 186	0,03	791
SVB FINL GROUP COM*	USD	214	204		418	92 407	0,03	
SYNOPSYS INC COM USD0.01*	USD	599	636	109	1 126	221 365	0,07	
TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01*	USD	481	390		871	132 214	0,04	
TARGA RESOURCES CO COM USD0.001*	USD	1 200	1 055	2 255				
TELADOC HEALTH INC COM USD0.001*	USD		585		585	117 835	0,04	585
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM*	USD		294		294	83 792	0,03	
TERADYNE INC COM USD0.125*	USD		1 480	277	1 203	87 824	0,03	1 203
THE TRADE DESK INC COM USD0.000001 CL A*	USD		316		316	150 615	0,05	
TRANSUNION COM USD0.01*	USD	776	605		1 381	106 744	0,03	
TRIMBLE INC COM NPV*	USD	1 214	1 112	492	1 834	82 059	0,03	
TRIPADVISOR INC COM USD0.001*	USD	444	800	1 244				
TWILIO INC COM USD0.001 CL A*	USD	584	389	86	887	201 361	0,06	887
TYLER TECHNOLOGIES INC COM*	USD		330		330	105 679	0,03	95
UDR INC*	USD	956	1 777	664	2 069	61 988	0,02	
UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.000333 CL A*	USD	1 200		1 200				
UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.0003333 CL C*	USD	808	2 079	2 887				
UNITED PARCEL SERVICE INC CL B*	USD	2 999	3 329	748	5 580	854 250	0,27	
VEEVA SYSTEMS INC COM USD0.00001 CL 'A'*	USD	601	661	259	1 003	259 118	0,08	
VERISIGN INC COM*	USD	507	385	108	784	147 553	0,05	
VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001*	USD	721	583	111	1 193	203 113	0,06	1 193
VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01*	USD	1 120	1 361	466	2 015	503 771	0,16	
VICI PPTY'S INC COM USD0.01*	USD		5 693	852	4 841	103 942	0,03	4 841
VMWARE INC COM STK USD0.01 CLASS 'A'*	USD	400	405	188	617	81 442	0,03	617
VORNADO REALTY TR COM USD0.04*	USD	568	654		1 222	37 847	0,01	1 222
VULCAN MATERIALS COM STK USD1*	USD	503	541		1 044	130 007	0,04	655
W P CAREY INC COM USD0.001*	USD	695	831		1 526	91 355	0,03	
WABTEC CORP COM*	USD	870	731		1 601	91 020	0,03	
WATERS CORP COM*	USD	298	258	100	456	81 980	0,03	382
WAYFAIR INC COM USD0.001 A*	USD	288	241		529	141 436	0,04	529
WEC ENERGY GROUP COM USD0.01*	USD	1 358	1 382	381	2 359	210 014	0,07	
WELLCARE HEALTH PL COM USD0.01*	USD	210	92	302				
WEST PHARMACEUTICA COM USD0.25*	USD		623	85	538	135 880	0,04	538
WESTERN UN CO COM*	USD	2 104	2 838	1 578	3 364	66 233	0,02	3 364
WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635*	USD	577	495	97	975	187 057	0,06	
XCEL ENERGY INC COM*	USD	1 992	3 129	1 034	4 087	259 128	0,08	1 808
ZAYO GROUP HOLDING COM USD0.001*	USD	1 034	734	1 768				
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP CL A*	USD	212	242		454	105 304	0,03	
ZILLOW GROUP INC COM USD0.0001 CLASS C WI*	USD	500	518		1 018	95 016	0,03	1 018
ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'*	USD	2 008	1 952	329	3 631	551 671	0,17	
ZSCALER INC COM USD0.001*	USD		500		500	64 629	0,02	
Total Vereinigte Staaten						46 854 127	14,81	
Total Inhaberaktien						96 224 201	30,41	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Weitere Aktien								
Vereinigte Staaten								
CAMDEN PROP TST SBI USD0.01*	USD	402	230		632	51 666	0,02	
Total Vereinigte Staaten						51 666	0,02	
Total Weitere Aktien						51 666	0,02	
Vorzugsaktien								
Deutschland								
BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1*	EUR	348			348	17 509	0,01	348
FUCHS PETROLUB SE NON-VTG PRF NPV*	EUR	316			316	14 769	0,00	316
HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV*	EUR	777	947	414	1 310	126 062	0,04	
PORSCHE AUTO HL SE NON VGT PRF NPV*	EUR	625	422		1 047	57 416	0,02	
SARTORIUS AG NON VGT PRF NPV*	EUR	122	170		292	110 233	0,03	149
VOLKSWAGEN AG NON VGT PRF NPV*	EUR	861	930	145	1 646	243 659	0,08	
Total Deutschland						569 648	0,18	
Total Vorzugsaktien						569 648	0,18	
Namensaktien								
Argentinien								
MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001*	USD	197	175	28	344	342 118	0,11	344
Total Argentinien						342 118	0,11	
Australien								
AMPOL LTD NPV*	AUD		2 019		2 019	31 842	0,01	
BENDIGO & ADELAIDE NPV*	AUD	1 672	3 534	5 206				
BHP GROUP LTD NPV*	AUD	12 608	11 850	1 942	22 516	527 845	0,17	22 516
BHP GROUP PLC ORD USD0.50*	GBP	8 566	8 825	1 398	15 993	314 153	0,10	
COLES GROUP LTD NPV*	AUD	5 040	6 511		11 551	129 310	0,04	11 551
SUNCORP GROUP LTD NPV DFD 08/10/19(EX-SPLIT)*	AUD	5 374		5 374				
TJAS LTD NPV*	AUD		2 175		2 175			
VODAFONE HUTCHISON NPV*	AUD		4 350		4 350	20 911	0,01	
Total Australien						1 024 062	0,32	
Belgien								
AGEAS NPV*	EUR	527	1 287	529	1 285	48 261	0,02	1 285
KBC GROUP NV NPV*	EUR	948	1 033		1 981	91 326	0,03	
TELENET GRP HLDG NPV*	EUR	279			279	9 961	0,00	279
UCB NPV*	EUR	632	1 345	773	1 204	125 824	0,04	
Total Belgien						275 372	0,09	
Kanada								
1ST QUANTUM MINLS COM NPV*	CAD	3 753	3 330	2 632	4 451	36 340	0,01	4 451
AGNICO EAGLE MINES LTD COM*	CAD	955	889		1 844	134 557	0,04	1 844
ALIMENTATION COUCHE TARD INC SUB VGT SH*	CAD	3 784	3 396	593	6 587	210 086	0,07	6 587
AURORA CANNABIS IN COM NPV(POST REV SPLIT)*	CAD		300	300				
BANK NOVA SCOTIA HALIFAX COM*	CAD	5 232	5 950	1 273	9 909	377 037	0,12	
BANK OF MONTREAL COM NPV*	CAD	2 620	3 193	707	5 106	273 373	0,09	5 106
BARRICK GOLD CORP COM NPV*	CAD	5 330	9 116	1 442	13 004	334 519	0,11	
BARRICK GOLD CORP COM NPV*	USD	2 089		1 578	511	13 197	0,00	
BCE INC COM NEW*	CAD	681	955	817	819	31 107	0,01	433
BLACKBERRY LTD NPV*	CAD	3 042			3 042	12 784	0,00	
BROOKFIELD ASSET M LTD VGT SHS NPV CL'A*	CAD	79	9 981	4 169	5 891	178 528	0,06	250
BROOKFIELD ASSET M LTD VGT SHS NPV CL'A**	USD	3 626	5 439	3 626	5 439	165 204	0,05	
CAN PACIFIC RYS COM NPV*	CAD	576	544	74	1 046	291 415	0,09	44
CANADIAN NAT RES LTD COM*	CAD	5 083	5 009	1 071	9 021	132 410	0,04	
CANADIAN NATL RY CO COM*	CAD	3 091	2 778	370	5 499	536 368	0,17	
CANADIAN TIRE LTD CL A*	CAD	329			329	30 350	0,01	329
CCL INDUSTRIES INC 'B'NON-VTG COM NPV*	CAD	615	679		1 294	45 694	0,01	
CDN IMPERIAL BK OF COMMERCE COM*	CAD	1 943	2 613	767	3 789	259 389	0,08	3 789
CENOVUS ENERGY INC COM NPV*	CAD	4 117	6 881		10 998	39 260	0,01	10 965
CGI INC COM NPV SUB VOTING SHARES C*	CAD	915	1 091	648	1 358	84 420	0,03	165
CONSTELLATION SOFT COM STK NPV*	CAD	100	45		145	147 568	0,05	145
CRONOS GROUP INC COM NPV*	CAD	900			900	4 141	0,00	
DOLLARAMA INC COM NPV*	CAD	1 400	1 803	1 067	2 136	74 987	0,02	
ENBRIDGE INC COM NPV*	CAD	8 730	9 211	1 355	16 586	443 776	0,14	
FAIRFAX FINL HLDGS SUB-VGT COM NPV*	CAD	146	84		230	62 029	0,02	
FIRST CAP REAL EST UNIT*	CAD		700		700	6 240	0,00	700
FORTIS INC COM NPV*	CAD	1 946	2 225	738	3 433	128 548	0,04	3 433
FRANCO NEVADA CORP COM NPV*	CAD	778	969	343	1 404	179 687	0,06	1 404
GILDAN ACTIVEWEAR INC COM*	CAD	700	4 304	2 225	2 779	50 156	0,02	2 779
GREAT WEST LIFECO INC COM*	CAD	1 223	1 104		2 327	41 646	0,01	2 327
IA FINANCIAL CORP COM NPV*	CAD	400	356		756	24 101	0,01	
IMPERIAL OIL LTD COM NEW*	CAD	1 072	1 220		2 292	25 129	0,01	2 292
INTACT FINL CORP COM NPV*	CAD	630	481		1 111	108 954	0,03	
INTER PIPELINE LTD COM NPV*	CAD	1 528	3 264	2 037	2 755	24 767	0,01	2 755
LOBLAW COS LTD COM*	CAD	712	471		1 183	56 738	0,02	
MAGNA INTL INC COM NPV*	CAD	1 234	1 402	504	2 132	89 349	0,03	
MANULIFE FINL CORP COM*	CAD	8 335	8 003		16 338	208 119	0,07	16 338
METRO INC CL A SUB*	CAD	1 260	1 049	447	1 862	81 825	0,03	1 862
NATL BK OF CANADA COM NPV*	CAD	1 344	1 480	406	2 418	110 000	0,03	
NUTRIEN LTD NPV*	CAD	2 515	2 497	522	4 490	161 240	0,05	
OPEN TEXT CO COM NPV*	CAD	1 000	1 270		2 270	87 872	0,03	
OVINTIV INC COM USD0.01*	CAD		1 242	1 242				
PARKLAND CORP COM NPV*	CAD		1 200		1 200	29 062	0,01	
PARKLAND CORP/CANADA*	CAD		1 200	1 200				
PEMBINA PIPELINE C COM NPV*	CAD	2 423	3 356	1 193	4 586	89 141	0,03	4 000
POWER CORP CDA COM*	CAD	1 341	4 166	1 052	4 455	79 945	0,03	
POWER FINL CORP COM NPV*	CAD	778	944	1 722				
RESTAURANT BRANDS COM NPV*	CAD	1 060	1 980	338	2 702	142 136	0,04	2 702

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ROGERS COMMS INC CLASS'B'COM CAD1.62478*	CAD	1 288	1 609		2 897	105 249	0,03	
ROYAL BK OF CANADA COM NPV*	CAD	6 341	6 859	2 241	10 959	704 706	0,22	
SAPUTO INC COM*	CAD	1 200	1 599	780	2 019	46 383	0,01	
SHAW COMMUNICATIONS INC CL B CONV*	CAD	2 164	3 500	2 149	3 515	58 749	0,02	
SHOPIFY INC COM NPV CL A*	CAD		550	107	443	414 910	0,13	443
SHOPIFY INC COM NPV CL A*	USD	400			400	375 941	0,12	
SNC-LAVALIN GROUP INC COM*	CAD	925		925				
SUN LIFE FINL INC COM*	CAD	2 537	4 133	2 126	4 544	169 586	0,05	2 400
SUNCOR ENERGY INC COM NPV 'NEW'*	CAD	6 644	6 297	1 075	11 866	132 708	0,04	4 990
TC ENERGY CORPORAT COM NPV*	CAD	3 940	3 830	678	7 092	272 680	0,09	
TECK RESOURCES LTD CLASS'B'SUB-VTG COM NPV*	CAD	1 895	3 494	1 772	3 617	46 124	0,01	
THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)*	USD	863			863	63 248	0,02	
THOMSON-REUTERS CP COM NPV(POST REV SPLIT)*	CAD		1 748	874	874	63 878	0,02	
TORONTO-DOMINION COM NPV*	CAD	8 043	8 827	2 999	13 871	588 184	0,19	13 871
WESTON GEORGE LTD COM*	CAD	291	301		592	39 868	0,01	
WHEATON PRECIOUS M COM NPV*	CAD	1 861	1 667		3 528	158 531	0,05	
Total Kanada						8 883 942	2,81	
Dänemark								
CARLSBERG SER'B'DKK20*	DKK	410	498	143	765	94 779	0,03	
COLOPLAST DKK 1 B*	DKK	494	473		967	140 450	0,04	225
DEMANT A/S DKK0.20*	DKK	415	1 641	1 425	631	18 220	0,01	631
H.LUNDBECK A/S DKK5*	DKK	351	752	749	354	10 734	0,00	
NOVO-NORDISK AS DKK0.2 SER'B'*	DKK	7 627	8 222	1 837	14 012	891 022	0,28	
TRYG A/S DKK5*	DKK	100	635		735	21 319	0,01	
VESTAS WIND SYSTEM DKK1*	DKK	796	1 104	332	1 568	233 755	0,07	1 568
Total Dänemark						1 410 279	0,45	
Finnland								
ELISA OYJ NPV*	EUR	418	1 163	402	1 179	63 867	0,02	1 179
FORTUM OYJ EUR3.40*	EUR	1 963	2 096		4 059	75 545	0,02	4 059
METSO OYJ NPV*	EUR		743	743				
NESTE OIL OYJ NPV*	EUR	2 118	2 188	1 152	3 154	152 809	0,05	2 845
NOKIA OYJ NPV*	EUR	23 146	24 856	5 972	42 030	151 695	0,05	42 030
NOKIAN RENKAAT OYJ NPV*	EUR	180	722	902				
ORION CORP SER'B'NPV*	EUR	196	768	370	594	24 747	0,01	594
SAMPO PLC SER'A'NPV*	EUR	1 744	2 705	856	3 593	130 801	0,04	3 593
STORA ENSO OYJ NPV SER'R'*	EUR	2 389	3 329	1 504	4 214	60 723	0,02	
UPM-KYMMENE CORP NPV*	EUR	2 109	2 419		4 528	126 788	0,04	
Total Finnland						786 975	0,25	
Frankreich								
GECINA EUR7.50*	EUR	156	139		295	35 819	0,01	295
LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)*	EUR		580		580	19 634	0,01	
MICHELIN (CGDE) EUR2*	EUR	772	652	193	1 231	121 643	0,04	
Total Frankreich						177 096	0,06	
Deutschland								
ADIDAS AG NPV (REGD)*	EUR	766	828	139	1 455	432 808	0,14	1 179
ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)*	EUR	1 829	2 217	667	3 379	595 649	0,19	1 545
BASF SE NPV*	EUR	3 968	4 092	1 102	6 958	389 661	0,12	
BAYER AG NPV (REGD)*	EUR	4 077	4 297	867	7 507	431 162	0,14	
BRENTAG AG*	EUR	581	770		1 351	79 035	0,02	
DAIMLER AG ORD NPV(REGD)*	EUR	3 898	4 544	1 218	7 224	358 287	0,11	
DELIVERY HERO SE NPV*	EUR	337	824	183	978	103 386	0,03	781
DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)*	EUR	9 269	6 933		16 202	125 506	0,04	
DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)*	EUR	808	768	105	1 471	237 405	0,08	
DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)*	EUR	1 016	4 496	4 684	828	6 566	0,00	828
DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)*	EUR	4 480	3 582	531	7 531	315 623	0,10	
DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)*	EUR	13 957	16 700	5 130	25 527	393 005	0,12	
E.ON SE NPV*	EUR	9 530	9 353	1 629	17 254	175 257	0,06	12 943
EVONIK INDUSTRIES NPV*	EUR	631	892		1 523	36 263	0,01	1 523
HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)*	EUR	300	216		516	73 493	0,02	
HUGO BOSS AG NPV (REGD)*	EUR	225		225				
INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)*	EUR	5 069	5 279	906	9 442	245 311	0,08	
LEG IMMOBILIEN AG NPV*	EUR		596		596	78 209	0,02	
MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)*	EUR	247	232	103	376	57 523	0,02	376
MUENCHENER RUECKVE NPV(REGD)*	EUR	612	839	247	1 204	280 964	0,09	
SCOUT24 AG NPV*	EUR		973		973	78 097	0,02	
SIEMENS AG NPV(REGD)*	EUR	3 288	3 426	639	6 075	706 078	0,22	1 727
SIEMENS ENERGY AG NPV*	EUR		3 038		3 038	75 268	0,02	
SIEMENS HEALTHINEE NPV*	EUR	632	771		1 403	57 892	0,02	
TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57*	USD	1 509	1 375	356	2 528	227 011	0,07	
TELEFONICA DEUTSCH NPV*	EUR	4 572			4 572	10 782	0,00	
TUI AG NPV (REGD)*	EUR	2 462		2 462				
TUI AG NPV (REGD)*	GBP		1 453	1 453				
UNIPER SE NPV*	EUR	942	729		1 671	49 616	0,02	1 671
UNITED INTERNET AG NPV(REGD)*	EUR	588	473	442	619	21 787	0,01	619
VONOVIA SE NPV*	EUR	2 070	2 846	782	4 134	260 907	0,08	
Total Deutschland						5 902 552	1,87	
Hongkong								
BUDWEISER BREWING USD0.00001*	HKD		11 200		11 200	29 874	0,01	
NEW WORLD DEVEL CO NPV(PARALLEL 29/07/20)*	HKD		10 283	10 283				
NEW WORLD DEVEL CO NPV POST CON*	HKD		10 283		10 283	45 714	0,01	
PACIFIC CENTURY PR HKD0.50*	HKD		2 333		2 333	561	0,00	
Total Hongkong						76 149	0,02	
Irland								
CRH ORD EURO.32*	EUR	3 529	1 984		5 513	183 354	0,06	
KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)*	EUR	468			468	39 177	0,01	
MEDTRONIC PLC USD0.0001*	USD	5 717	6 314	1 470	10 561	1 008 327	0,32	
SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001*	EUR	1 118			1 118	40 375	0,01	
Total Irland						1 271 233	0,40	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Israel								
ISRACARD LTD NPV*	ILS		367	367				
MIZRAHI TEFAHOT BK ILS0.01*	ILS	218	731		949	15 484	0,00	
Total Israel						15 484	0,00	
Italien								
ATLANTIA SPA EUR1*	EUR	2 516	1 192		3 708	53 651	0,02	3 708
CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01*	EUR	4 408	2 984		7 392	52 944	0,02	6 450
DAVIDE CAMPARI MIL EURO.05*	EUR		4 882		4 882	49 015	0,02	4 882
DAVIDE DE CAMPARI EURO.05 (POST SUBD)*	EUR	1 811	3 071	4 882				
ENEL EUR1*	EUR	35 125	33 647	7 053	61 719	493 255	0,16	
ENI SPA EUR1*	EUR	11 380	10 588	2 608	19 360	139 498	0,04	19 360
FERRARI NV EURO.01(NEW)*	EUR	498	591		1 089	183 791	0,06	372
INTESA SANPAOLO NPV*	EUR	63 049	74 273	12 945	124 377	214 803	0,07	
MEDIOBANCA SPA EURO.5*	EUR	2 929			2 929	21 136	0,01	2 929
MONCLER SPA NPV*	EUR	595	1 083		1 678	63 238	0,02	1 678
NEXI SPA NPV*	EUR		5 938	1 092	4 846	89 383	0,03	4 846
PIRELLI & C. SPA NPV*	EUR	2 627			2 627	10 364	0,00	2 627
PRYSMIAN SPA EURO.10*	EUR	555	1 003		1 558	41 695	0,01	
RECORDATI EURO.125*	EUR	327	556		883	41 611	0,01	883
SNAM EUR1*	EUR	8 493	9 861	5 936	12 418	58 720	0,02	12 418
TERNA SPA ORD EURO.22*	EUR	5 894	12 903	4 065	14 732	94 818	0,03	14 732
UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)*	EUR	9 448	7 137		16 585	125 882	0,04	16 585
Total Italien						1 733 804	0,55	
Japan								
ABC-MART INC NPV*	JPY	300			300	14 287	0,00	
AEON CO LTD NPV*	JPY	2 400	3 800	1 300	4 900	120 556	0,04	4 900
AEON MALL CO LTD NPV*	JPY		1 700	1 700				
AGC INC NPV*	JPY	900			900	24 055	0,01	
AJINOMOTO CO INC NPV*	JPY	2 000	1 500		3 500	65 787	0,02	
ALFRESA HOLDINGS NPV*	JPY	1 000			1 000	20 007	0,01	
ALPS ALPINE CO LTD NPV*	JPY	1 100		1 100				
ANA HOLDINGS INC NPV*	JPY	500	700		1 200	25 387	0,01	
ASAHI GROUP HLDGS NPV*	JPY	1 600	1 500		3 100	98 671	0,03	
ASAHI KASEI CORP NPV*	JPY	5 300	5 800	2 300	8 800	70 078	0,02	
ASTELLAS PHARMA NPV*	JPY	8 000	7 100	1 100	14 000	190 993	0,06	
BRIDGESTONE CORP NPV*	JPY	2 500	2 500	1 100	3 900	112 624	0,04	
BROTHER INDUSTRIES NPV*	JPY	1 300	1 000	1 000	1 300	18 856	0,01	
CANON INC NPV*	JPY	4 500	2 800		7 300	110 997	0,04	7 300
CASIO COMPUTER CO NPV*	JPY		2 100		2 100	30 971	0,01	
CHUBU ELEC POWER NPV*	JPY	2 500	3 100		5 600	62 454	0,02	
CHUGOKU ELEC POWER NPV*	JPY	1 500			1 500	17 225	0,01	
DAI NIPPON PRINTING NPV*	JPY	600	1 800	800	1 600	29 615	0,01	
DAIWA SECS GROUP NPV*	JPY	3 500	9 900		13 400	51 413	0,02	
DENSO CORP NPV*	JPY	1 900	1 300		3 200	128 070	0,04	
DENTSU GROUP INC NPV*	JPY	900	1 000		1 900	51 196	0,02	1 900
EAST JAPAN RAILWAY NPV*	JPY	1 400	1 100	300	2 200	124 114	0,04	
ELEC POWER DEV NPV*	JPY	800			800	11 304	0,00	
ENEOS HOLDINGS INC NPV*	JPY	12 500	10 800		23 300	76 069	0,02	
FAMILYMART CO LTD NPV*	JPY	1 200	2 600	2 100	1 700	35 077	0,01	1 700
FUJIFILM HLD CORP NPV*	JPY	1 300	1 800	400	2 700	121 880	0,04	
FUJITSU NPV*	JPY	900	900	200	1 600	199 752	0,06	
HAKUHODO DY HLDGS NPV*	JPY	1 000	1 500		2 500	29 492	0,01	
HAMAMATSU PHOTONIC NPV*	JPY	700	500		1 200	55 266	0,02	
HINO MOTORS NPV*	JPY	2 000	3 000	4 600	400	2 365	0,00	
HITACHI CONST MACH NPV*	JPY	300	1 000		1 300	43 008	0,01	
HITACHI METALS NPV*	JPY	1 000	2 400		3 400	47 805	0,02	
HITACHI NPV*	JPY	3 900	4 200	700	7 400	228 257	0,07	
HONDA MOTOR CO NPV*	JPY	6 900	6 700	1 200	12 400	267 027	0,08	
HOYA CORP NPV*	JPY	1 700	1 400	200	2 900	299 436	0,09	
IIDA GROUP HOLDING NPV*	JPY	900	1 400	1 300	1 000	18 483	0,01	
INPEX CORPORATION NPV*	JPY	3 200	5 000		8 200	40 228	0,01	
ITOCHU CORP NPV*	JPY	6 000	5 100	900	10 200	238 433	0,08	
JAPAN AIRLINES CO NPV*	JPY	600	1 000	1 000	600	10 270	0,00	
JAPAN POST BANK CO NPV*	JPY	2 400	2 300		4 700	33 594	0,01	
JAPAN POST HOLD CO NPV*	JPY	7 700	10 300	4 500	13 500	84 129	0,03	
JAPAN PRIME REALTY INVESTMENT CORP*	JPY	4	7		11	31 268	0,01	
JAPAN RETAIL FUND INVESTMENT CORP*	JPY	12	13		25	35 347	0,01	
JAPAN TOBACCO INC NPV*	JPY	4 900	7 300	1 500	10 700	178 857	0,06	
JFE HOLDINGS INC NPV*	JPY	1 700	2 800		4 500	28 678	0,01	
KDDI CORP NPV*	JPY	7 800	7 700	3 000	12 500	289 041	0,09	
KEYENCE CORP NPV*	JPY	340	1 680	540	1 480	631 105	0,20	
KOBE STEEL NPV*	JPY	1 500		1 500				
KONAMI HOLDINGS CORP NPV*	JPY	500	600		1 100	43 478	0,01	
KONICA MINOLTA INC NPV*	JPY	900	3 700	4 600				
KUBOTA CORP NPV*	JPY	4 600	4 200		8 800	143 841	0,05	
KYOCERA CORP NPV*	JPY	1 500	1 200	300	2 400	125 305	0,04	
KYOWA KIRIN CO LTD NPV*	JPY	1 100	1 000		2 100	54 592	0,02	
LAWSON INC NPV*	JPY	200	400	300	300	13 111	0,00	300
LIXIL GROUP CORP COM NPV*	JPY	1 100	1 400		2 500	45 924	0,01	
MARUBENI CORP NPV*	JPY	6 700	6 700	2 600	10 800	55 898	0,02	
MAZDA MOTOR CORP NPV*	JPY	2 200	2 800		5 000	26 597	0,01	
MEDIPAL HOLDINGS CORP NPV*	JPY	400	900		1 300	23 824	0,01	
MERCARI INC NPV*	JPY		2 000	1 100	900	38 002	0,01	900
mitsubishi chem hl NPV*	JPY	4 600	6 500	3 100	8 000	42 186	0,01	
mitsubishi corp NPV*	JPY	5 400	6 100	1 200	10 300	225 302	0,07	
mitsubishi elec cp NPV*	JPY	8 100	12 900	5 100	15 900	196 773	0,06	
mitsubishi estate NPV*	JPY	5 600	4 900	1 700	8 800	121 585	0,04	
mitsubishi hvv ind NPV*	JPY	1 300	1 700	800	2 200	44 637	0,01	
mitsubishi materls NPV*	JPY	100	700		800	14 417	0,00	
mitsubishi tanabe pharma corp NPV*	JPY	1 000		1 000				
mitsubishi ufj fin NPV*	JPY	51 200	50 200	7 400	94 000	340 523	0,11	
MITSUI & CO NPV*	JPY	6 500	7 400	1 300	12 600	197 782	0,06	
MITSUI O.S.K.LINES NPV*	JPY		700	700				
MIZUHO FINL GP NPV*	JPY	106 300	105 450	192 500	19 250	219 629	0,07	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS INC NPV*	JPY	1 862	1 800		3 662	90 034	0,03	
MURATA MFG CO NPV*	JPY	2 300	2 500	500	4 300	253 554	0,08	
NEC CORP NPV*	JPY	1 200	1 000		2 200	117 601	0,04	
NEXON CO LTD NPV*	JPY	1 300	2 100		3 400	77 613	0,02	
NGK INSULATORS NPV*	JPY	800	1 900		2 700	35 142	0,01	
NGK SPARK PLUG CO NPV*	JPY	900	1 200	1 200	900	14 339	0,00	
NIKON CORP NPV*	JPY	2 100			2 100	12 944	0,00	
NINTENDO CO LTD NPV*	JPY	500	700	300	900	467 463	0,15	
NIPPON PROLOGIS RE REIT*	JPY	5	9		14	43 330	0,01	
NIPPON TEL&TEL CP NPV*	JPY	2 700	11 300	3 600	10 400	194 667	0,06	
NIPPON YUSEN KK NPV*	JPY	600			600	9 491	0,00	
NISSAN MOTOR CO NPV*	JPY	8 200	16 200	10 100	14 300	46 288	0,01	
NOMURA HOLDINGS NPV*	JPY	13 800	13 500	4 100	23 200	96 668	0,03	
NOMURA REAL EST MA REIT*	JPY	14	14		28	32 178	0,01	
NOMURA RESEARCH IN NPV*	JPY	1 341	1 900	900	2 341	63 079	0,02	
NTT DATA CORP NPV*	JPY	2 200	3 600		5 800	67 764	0,02	
NTT DOCOMO NPV*	JPY	5 400	5 400	2 000	8 800	297 643	0,09	
OMRON CORP NPV*	JPY	1 200	300		1 500	106 823	0,03	
ORIX CORP NPV*	JPY	6 000	5 200	1 400	9 800	111 342	0,04	
ORIX JREIT INC REIT*	JPY		35	19	16	22 469	0,01	
OSAKA GAS CO NPV*	JPY	1 300	1 200		2 500	44 619	0,01	
OTSUKA CORP NPV*	JPY	600	400		1 000	46 839	0,01	
OTSUKA HLDGS CO NPV*	JPY	1 600	1 500		3 100	120 046	0,04	
PANASONIC CORP NPV*	JPY	10 000	9 400	2 700	16 700	129 224	0,04	
PARK 24 CO LTD NPV*	JPY	400	1 000		1 400	20 684	0,01	1 400
RENESAS ELECTRONIC NPV*	JPY	2 500	2 800		5 300	35 299	0,01	
RESONA HOLDINGS NPV*	JPY	9 000	11 400	5 400	15 000	46 699	0,01	
RICOH CO NPV*	JPY	3 200			3 200	19 669	0,01	
ROHM CO LTD NPV*	JPY	500	400		900	63 467	0,02	
SANTEN PHARM CO NPV*	JPY	2 100			2 100	39 290	0,01	
SEGA SAMMY HLDGS I NPV*	JPY	400	1 600		2 000	22 253	0,01	
SEIKO EPSON CORP NPV*	JPY	500	1 300		1 800	18 883	0,01	
SEKISUI CHEMICAL NPV*	JPY	1 500	2 800	1 700	2 600	37 960	0,01	
SEVEN & I HOLDINGS NPV*	JPY	3 100	3 200	600	5 700	161 280	0,05	
SG HOLDINGS CO LTD NPV*	JPY	300	1 100		1 400	66 427	0,02	
SHIMADZU CORP NPV*	JPY	1 100	1 800	1 600	1 300	36 104	0,01	
SHIMAMURA CO NPV*	JPY	100	300		400	35 625	0,01	
SOFTBANK CORP NPV*	JPY	7 600	15 500		23 100	236 807	0,07	
SOFTBANK GROUP CO NPV*	JPY	7 000	6 500	1 500	12 000	675 834	0,21	
SOHGO SECURITY SER NPV*	JPY	400			400	17 412	0,01	
SOMPO HOLDINGS INC NPV*	JPY	1 625	1 200		2 825	89 254	0,03	
SONY CORP NPV*	JPY	5 400	6 100	1 400	10 100	706 263	0,22	
SUBARU CORPORATION NPV*	JPY	2 800	2 600		5 400	95 530	0,03	
SUMCO CORPORATION NPV*	JPY	700	2 700	1 500	1 900	24 399	0,01	1 900
SUMITOMO CHEM CO NPV*	JPY	9 000			9 000	27 189	0,01	
SUMITOMO CORP NPV*	JPY	5 400	4 900	1 600	8 700	95 322	0,03	
SUMITOMO DAINIPPON PHARMA CO LTD*	JPY	700	1 300		2 000	24 081	0,01	
SUMITOMO ELECTRIC NPV*	JPY	2 100	3 200		5 300	54 402	0,02	
SUMITOMO MITSUI FG NPV*	JPY	5 800	5 100	1 000	9 900	251 459	0,08	
SUMITOMO MITSUI TR NPV*	JPY	1 341	1 900	800	2 441	59 345	0,02	
SUMITOMO RLTY&DEV NPV*	JPY	1 600	1 400	700	2 300	62 114	0,02	
TAKEDA PHARMACEUTI NPV*	JPY	6 159	6 800	900	12 059	393 069	0,12	
TDK CORP NPV*	JPY	500	700	300	900	89 402	0,03	
TOKIO MARINE HLDG NPV*	JPY	2 600	2 700	500	4 800	192 230	0,06	
TOKYO ELEC POWER H NPV*	JPY	6 700	5 700		12 400	31 199	0,01	
TOKYO ELECTRON NPV*	JPY	700	800	400	1 100	261 730	0,08	
TOKYU FUDOSAN HLDG NPV*	JPY	4 000			4 000	15 706	0,00	
TOPPAN PRINTING CO NPV*	JPY	1 500	1 500	1 200	1 800	23 162	0,01	
TOSHIBA CORP NPV*	JPY	2 200	700		2 900	67 436	0,02	
TOYO SEIKAN GROUP NPV*	JPY	600	1 400	2 000				
TOYOTA MOTOR CORP NPV*	JPY	9 734	10 800	3 400	17 134	1 034 043	0,33	
TREND MICRO INC NPV*	JPY	600	700	300	1 000	55 806	0,02	
UNICLARM CORP NPV*	JPY	1 900	1 500	500	2 900	118 967	0,04	
UNITED URBAN INVESTMENT CORP*	JPY	9	26	17	18	18 288	0,01	
WEST JAPAN RAILWAY NPV*	JPY	700	700	300	1 100	49 712	0,02	
YAMADA HOLDINGS CO NPV*	JPY	3 900	4 000		7 900	36 040	0,01	
YAMAHA MOTOR CO NPV*	JPY	1 600			1 600	21 201	0,01	
YAMAZAKI BAKING CO NPV*	JPY	100	1 000		1 100	17 611	0,01	1 089
YASKAWA ELEC CORP NPV*	JPY	1 200	1 300	500	2 000	71 303	0,02	2 000
YOKOGAWA ELECTRIC NPV*	JPY	1 300	1 400		2 700	39 138	0,01	
YOKOHAMA RUBBER CO NPV*	JPY	600			600	7 788	0,00	
Z HOLDINGS CORP NPV*	JPY	15 000	6 700		21 700	132 056	0,04	
Total Japan						14 577 026	4,61	
Luxemburg								
ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)*	EUR	2 326	5 449	1 772	6 003	73 626	0,02	
TENARIS S.A. USD1*	EUR	2 658	3 081	4 843	896	4 113	0,00	896
Total Luxemburg						77 739	0,02	
Niederlande								
ADYEN NV EURO.01*	EUR	40	114	18	136	230 407	0,07	
AEGON NV EURO.12*	EUR	6 100	5 696		11 796	28 213	0,01	
ASML HOLDING NV EURO.09*	EUR	1 846	1 939	451	3 334	1 130 389	0,36	
EQT AB NPV*	SEK		2 017		2 017	36 069	0,01	2 017
FIAT CHRYSLER AUTO EURO.01*	EUR	4 078	5 596	1 926	7 748	87 381	0,03	
KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5*	EUR	715	1 078	266	1 527	231 308	0,07	
NN GROUP N.V. EURO.12*	EUR	1 408	1 527	556	2 379	82 146	0,03	
PROSUS N.V. EURO.05*	EUR	1 905	2 839	685	4 059	344 159	0,11	
Total Niederlande						2 170 073	0,69	
Norwegen								
ADEVINTA ASA SER'B'NOK0.2*	NOK		1 910		1 910	30 064	0,01	
AKER BP ASA NOK1*	NOK		617	617				
DNB ASA NOK10*	NOK	3 791	3 833		7 624	96 797	0,03	
EQUINOR ASA NOK2.50*	NOK	3 718	6 754	3 257	7 215	94 084	0,03	
MOWI ASA NOK7.50*	NOK	1 658	2 344		4 002	65 174	0,02	4 002
NORSK HYDRO ASA NOK3.6666*	NOK	6 226	9 105	6 618	8 713	22 022	0,01	
TELENOR ASA ORD NOK6*	NOK	3 632	5 619	3 756	5 495	84 416	0,03	
Total Norwegen						392 555	0,12	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Portugal								
EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)*	EUR	12 998	18 671	3 945	27 724	125 301	0,04	6 213
GALP ENERGIA EUR1-B*	EUR	2 267	3 102	1 537	3 832	32 665	0,01	
JERONIMO MARTINS EUR5*	EUR	1 356	5 013	4 210	2 159	31 878	0,01	
Total Portugal						189 844	0,06	
Singapur								
GENTING SINGAPORE LTD*	SGD	28 000			28 000	12 626	0,00	
SINGAPORE TELECOMM NPV*	SGD	30 600	23 000		53 600	76 477	0,02	
Total Singapur						89 103	0,03	
Spanien								
BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)*	EUR	73 548	77 620	24 075	127 093	219 028	0,07	
BANKINTER SA EURO.3(REGD)*	EUR	2 723	4 305		7 028	27 841	0,01	7 028
BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49*	EUR	29 751	34 839	14 019	50 571	129 236	0,04	50 571
MAPFRE SA EURO.10*	EUR	6 782	11 166	9 469	8 479	12 214	0,00	8 479
Total Spanien						388 318	0,12	
Schweden								
ALFA LAVAL AB NPV*	SEK	1 410	1 154		2 564	52 325	0,02	2 564
ATLAS COPCO AB SER'A/NPV (POST SPLIT)*	SEK	2 626	4 381	1 995	5 012	220 618	0,07	5 012
ATLAS COPCO AB SER'B/NPV (POST SPLIT)*	SEK	1 360	1 947		3 307	127 371	0,04	
BOLIDEN AB NPV (POST SPLIT)*	SEK	1 319	2 144	1 261	2 202	60 286	0,02	2 202
ELECTROLUX AB SER'B/NPV (POST SPLIT)*	SEK	1 252	1 312	1 126	1 438	30 911	0,01	4
ELECTROLUX PROFESS SER'B/NPV*	SEK		1 252					
EPIROC AB SER'A/NPV*	SEK	2 031	3 436		5 467	73 041	0,02	3 411
EPIROC AB SER'B/NPV*	SEK	2 051	1 789		3 840	49 155	0,02	
ERICSSON SER'B' NPV*	SEK	13 889	17 415	9 566	21 738	219 310	0,07	
EVOLUTION GAMING NPV*	SEK		1 160		1 160	70 828	0,02	1 160
HENNES & MAURITZ SER'B/NPV*	SEK	2 833	4 369	1 245	5 957	94 631	0,03	5 957
HEXAGON AB SER'B/NPV*	SEK	1 200	1 012		2 212	153 908	0,05	2 212
INVESTOR AB SER'B/NPV*	SEK	2 029	3 608	2 166	3 471	209 154	0,07	
KINNEVIK AB SER'B/NPV (POST SPLIT)*	SEK		1 854		1 854	69 400	0,02	1 854
NORDEA HOLDING AB NPV*	EUR	218			218	1 524	0,00	218
NORDEA HOLDING AB NPV*	SEK	13 053	13 152	2 794	23 411	164 164	0,05	
SANDVIK AB NPV (POST SPLIT)*	SEK	5 039	4 157		9 196	166 050	0,05	9 196
SKAND ENSKILDA BKN SER'A/NPV*	SEK	7 544	9 074	3 543	13 075	106 893	0,03	2 370
SKF AB SER'B/NPV*	SEK	1 266	2 473	1 016	2 723	51 908	0,02	2 723
SWEDBANK AB SER'A/NPV*	SEK	4 553	9 128	5 077	8 604	124 306	0,04	5 505
SWEDISH MATCH NPV*	SEK	787	724	340	1 171	88 088	0,03	
TELE2 AB SHS*	SEK	2 117	3 126	1 855	3 388	44 100	0,01	3 388
VOLVO AB SER'B/NPV (POST SPLIT)*	SEK	6 460	9 370	3 035	12 795	227 293	0,07	12 795
Total Schweden						2 405 264	0,76	
Schweiz								
COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70*	GBP	651	822		1 473	33 452	0,01	
COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70*	EUR	495			495	11 359	0,00	
Total Schweiz						44 811	0,01	
Grossbritannien								
ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001*	GBP	628	689		1 317	40 843	0,01	
AMCOR PLC ORD USDO.01*	USD	1 700	5 834		7 534	76 487	0,02	
ANGLO AMERICAN USDO.54945*	GBP	4 144	6 015	1 044	9 115	203 082	0,06	
ANTOFAGASTA ORD GBPO.05*	GBP	1 168	2 007		3 175	38 598	0,01	
ASHTED GROUP ORD GBPO.10*	GBP	1 705	2 106		3 811	126 743	0,04	
ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568*	GBP	1 547	816		2 363	52 415	0,02	
AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01*	GBP	5 332	3 442		8 774	58 673	0,02	
BARCLAYS ORD GBPO.25*	GBP	69 046	79 919	21 659	127 306	147 595	0,05	
BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.05*	GBP	755	420	337	838	42 083	0,01	
BP ORD USDO.25*	GBP	87 414	84 470	17 272	154 612	413 562	0,13	
BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005*	GBP	2 044	1 658		3 702	68 331	0,02	
CENTRICA ORD GBPO.061728395*	GBP	29 229		29 229				
COMPASS GROUP ORD GBPO.1105*	GBP	6 879	8 170	1 269	13 780	191 334	0,06	
CRODA INTL ORD GBPO.10609756*	GBP	468	587		1 055	78 318	0,02	
DIAGEO ORD GBPO.28 101/108*	GBP	10 157	9 509	1 993	17 673	556 269	0,18	
DIRECT LINE INSURA ORD GBP 0.109090909*	GBP	4 944	5 982		10 926	34 961	0,01	
EASYJET ORD GBPO.27285714*	GBP		868					
EXPERIAN ORD USDO.10*	GBP	4 084	3 347	691	6 740	233 761	0,07	
FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10*	GBP	1 048	861	252	1 657	153 749	0,05	
G4S ORD GBPO.25*	GBP	4 954	8 755	13 709				
GLAXOSMITHKLINE ORD GBPO.25*	GBP	21 383	21 230	4 400	38 213	659 032	0,21	
GVC HLDGS PLC ORD EURO.01*	GBP	2 496	2 149		4 645	53 737	0,02	
HARGREAVES LANSLOW ORD GBPO.004 (WJ)*	GBP	1 435	1 182		2 617	48 553	0,02	
HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)*	GBP	86 737	80 796	12 426	155 107	555 453	0,18	
IMPERIAL BRANDS PL GBPO.10*	GBP	4 066	3 715		7 781	126 384	0,04	
INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303*	GBP	779	665		1 444	70 217	0,02	
INTERTEK GROUP ORD GBPO.01*	GBP	634	748		1 382	103 972	0,03	
INVESTEC ORD GBPO.0002*	GBP	4 259		4 259				
LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025*	GBP	27 386	21 161		48 547	108 607	0,03	
LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 C*	USD	1 972	3 617	904	4 685	88 390	0,03	
LINDE PLC COM EURO.001*	EUR	695		371	324	70 477	0,02	
LINDE PLC COM EURO.001*	USD	1 669	2 244		3 913	856 094	0,27	
LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604*	GBP	1 363	1 193	212	2 344	247 118	0,08	
M&G PLC ORD GBPO.05*	GBP		23 592		23 592	44 695	0,01	
MICRO FOCUS INTL ORD GBPO.10*	GBP	743	1 749	2 492				
MONDI ORD EURO.20*	GBP	2 256	1 957		4 213	82 041	0,03	
MORRISON(W)SUPRMKT ORD GBPO.10*	GBP	10 569	8 478		19 047	38 493	0,01	
NATWEST GROUP PLC ORD GBP1*	GBP	19 324	32 394	13 759	37 959	47 814	0,02	
NEXT ORD GBPO.10*	GBP	563	669	311	921	65 089	0,02	
PEARSON ORD GBPO.25*	GBP	4 076	8 915	5 144	7 847	51 187	0,02	
PERSIMMON ORD GBPO.10*	GBP	1 176	1 056		2 232	65 561	0,02	
PRUDENTIAL ORD GBPO.05*	GBP	11 120	10 385	1 259	20 246	266 686	0,08	
RIO TINTO ORD GBPO.10*	GBP	5 129	4 311	925	8 515	470 847	0,15	
ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A'SHS EURO.07*	EUR	18 169			18 169	210 977	0,07	

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ROYAL DUTCH SHELL PLC 'A'SHS EURO.07*	GBP 519	16 016	3 409	13 126	150 277	0,05	
RSA INSURANCE GRP ORD GBP1.00*	GBP 5 676	4 107	3 585	6 198	33 253	0,01	
SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428*	GBP 8 655			8 655	19 630	0,01	
SCHROEDERS VTG SHS GBP1*	GBP 750			750	24 008	0,01	
SMITH & NEPHEW ORD USDO.20*	GBP 3 840	4 423	1 943	6 320	113 838	0,04	
STANDARD CHARTERED ORD USDO.50*	GBP 12 339	11 757	4 106	19 990	84 550	0,03	
STD LIFE ABERDEEN ORD GBPO.1396825396*	GBP 8 846	12 701	5 882	15 665	42 050	0,01	
TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01*	GBP 13 222	19 432		32 654	42 062	0,01	
TESCO ORD GBPO.05*	GBP 41 638	36 510		78 148	197 245	0,06	
UNILEVER PLC ORD GBPO.0311111*	GBP 4 993	4 722	854	8 861	502 662	0,16	
VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)*	GBP 113 770	113 100	20 197	206 673	252 057	0,08	
WHITBREAD ORD GBPO.76797385(FP 09/06/)*	GBP	410	410				
Total Grossbritannien					8 309 857	2,63	
Vereinigte Staaten							
ABBOTT LABS COM*	USD 7 541	8 126	1 866	13 801	1 379 928	0,44	
ABBVIE INC COM USDO.01*	USD 6 411	8 900	1 517	13 794	1 110 049	0,35	
ABIOMED INC COM*	USD 151	229		380	96 729	0,03	380
ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'*	USD 2 733	2 890	618	5 005	1 039 180	0,33	
ACTIVISION BLIZZARD COM STK USDO.000001*	USD 3 090	3 684	529	6 245	464 458	0,15	
ACUITY BRANDS INC COM STK USDO.01*	USD 162	178	340				
ADOBE INC COM USDO.0001*	USD 2 104	2 263	605	3 762	1 695 092	0,54	
ADVANCE AUTO PARTS COM USDO.0001*	USD 270	154		424	59 796	0,02	390
ADVANCED MICRO DEV COM USDO.01*	USD 4 291	6 117	884	9 524	717 427	0,23	
AES CORP COM*	USD 2 895	2 867		5 762	95 871	0,03	5 762
AFFILIATED MNGRS COM USDO.01*	USD 300		300				
AGILENT TECHNOLOGIES INC COM*	USD 1 282	1 741	688	2 335	216 545	0,07	
AGNC INV CORP COM USDO.01*	USD 2 411	2 796	1 429	3 778	48 282	0,02	
AIR PRODS & CHEMS COM USD1*	USD 929	946	185	1 690	462 484	0,15	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM*	USD 492	1 025	416	1 101	161 847	0,05	
ALEXION PHARMACEUT COM USDO.0001*	USD 919	948	159	1 708	179 566	0,06	
ALLEGION PLC CIM USDO.01*	USD 400	487		887	80 605	0,03	215
ALLERGAN PLC COM USDO.0001*	USD 1 360	962	2 322				
ALLSTATE CORP COM*	USD 1 349	1 792	360	2 781	240 532	0,08	2 781
ALLY FINANCIAL INC COM USDO.01*	USD 2 143	2 227	1 728	2 642	60 853	0,02	
ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL A*	USD 1 292	1 275	242	2 325	3 130 659	0,99	
ALTRIA GROUP INC COM USDO.333333*	USD 8 071	7 531	1 393	14 209	504 427	0,16	
AMAZON COM INC COM USDO.01*	USD 1 805	1 934	425	3 314	9 587 056	3,03	
AMER EXPRESS CO COM USDO.20*	USD 3 044	4 004	1 755	5 293	487 510	0,15	5 293
AMER FINL GP OHIO COM NPV*	USD 300	290		590	36 307	0,01	
AMER INTL GRP COM USD2.50*	USD 3 745	4 309	1 020	7 034	177 912	0,06	7 034
AMER TOWER CORP COM NEW USDO.01*	USD 1 900	2 111	446	3 565	791 749	0,25	
AMEREN CORP COM*	USD 931	1 300	448	1 783	129 543	0,04	1 783
AMERIPRISE FINL INC COM*	USD 600	494	125	969	137 199	0,04	
AMERISOURCEBERGEN COM STK USDO.01*	USD 682	497		1 179	104 984	0,03	
AMETEK INC COM USDO.01*	USD 978	1 058	354	1 682	153 607	0,05	1 682
AMGEN INC COM USDO.0001*	USD 2 668	2 702	735	4 635	1 082 317	0,34	4 635
AMPHENOL CORP NEW CL A*	USD 1 228	1 336	317	2 247	223 516	0,07	585
ANALOG DEVICES INC COM*	USD 1 676	1 597	467	2 806	300 957	0,10	2 806
ANNALY CAPITAL MAN COM USDO.01*	USD 6 412	4 031		10 443	68 313	0,02	
ANTHEM INC COM USDO.01*	USD 1 084	1 020	174	1 930	476 260	0,15	
AON PLC COM USDO.01 CL A*	USD 2 159	2 159	200	1 959	371 305	0,12	
APACHE CORP COM USDO.625*	USD 1 672	2 178	3 850				
APOLLO GLOBAL MANA COM USDO.00001 CLASS A*	USD	1 563	400	1 163	47 816	0,02	
APPLE INC COM NPV*	USD 19 838	155 968	39 813	135 993	14 469 715	4,57	
APPLIED MATLS INC COM*	USD 4 113	4 699	1 282	7 530	411 286	0,13	7 530
APTIV PLC COM USDO.01*	USD 1 165	1 044	236	1 973	166 188	0,05	1 362
ARAMARK COM USDO.01*	USD 1 200	828		2 028	49 282	0,02	
ARCH CAPITAL GROUP COM USDO.01*	USD 1 728	1 479		3 207	86 183	0,03	
ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM*	USD 2 438	2 615	656	4 397	187 808	0,06	4 397
ARCONIC CORPORATIO COM USDO.01*	USD	730	730				
ASSURANT INC COM*	USD 212	680	311	581	64 755	0,02	496
AT&T INC COM USD1*	USD 31 412	33 387	8 013	56 786	1 487 428	0,47	
ATHENE HOLDING LTD COM USDO.001 CL A*	USD 900			900	28 180	0,01	
ATMOS ENERGY CORP COM*	USD 516	462		978	85 891	0,03	978
AUTO DATA PROCESS COM USDO.10*	USD 1 968	1 871	533	3 306	423 685	0,13	
AUTODESK INC COM USDO.01*	USD 974	844	139	1 679	356 352	0,11	
AUTOLIV INC COM*	USD 212	572		784	52 495	0,02	784
AUTOZONE INC COM USDO.01*	USD 108	88		196	212 064	0,07	134
AVALARA INC COM USDO.0001*	USD	919		919	107 517	0,03	
AVALONBAY COMMUNI COM USDO.01*	USD 605	593	138	1 060	145 438	0,05	
AVANTOR INC COM USDO.01*	USD	4 882		4 882	100 875	0,03	4 882
AVERY DENNISON CORP COM*	USD 399	249		648	76 110	0,02	
AXALTA COATING SYS COM USD1.00*	USD 1 129	1 057		2 186	44 526	0,01	
BALL CORP COM NPV*	USD 1 373	1 291	261	2 403	183 509	0,06	2 403
BAUSCH HEALTH COMP COM NPV*	CAD 1 380	1 847	947	2 280	32 462	0,01	2 280
BAXTER INTL INC COM USD1*	USD 2 061	2 464	691	3 834	283 278	0,09	
BECTON DICKINSON COM USD1*	USD 1 156	1 231	191	2 196	469 449	0,15	
BEST BUY CO INC COM USDO.10*	USD 1 159	922	345	1 736	177 502	0,06	
BIOGEN INC COM STK USDO.0005*	USD 849	647	175	1 321	344 294	0,11	
BK OF AMERICA CORP COM USDO.01*	USD 38 950	38 631	17 610	59 971	1 327 319	0,42	
BK OF NY MELLON CP COM STK USDO.01*	USD 3 591	4 479	1 021	7 049	222 395	0,07	
BLACKSTONE GRP INC COM USDO.00001 CLASS A*	USD	6 100	1 000	5 100	244 590	0,08	
BOEING CO COM USD5*	USD 2 305	2 545	605	4 245	644 529	0,20	
BOOKING HLDGS INC COM USDO.008*	USD 189	156	25	320	502 940	0,16	
BORG WARNER INC COM*	USD 986	540		1 526	54 314	0,02	1 526
BRIGHTHOUSE FINL I COM USDO.01 WI*	USD 636		636				
BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USDO.10*	USD 7 003	13 347	2 564	17 786	985 192	0,31	
BROADCOM CORP COM USD1.00*	USD 1 750	1 843	379	3 214	1 075 787	0,34	1 000
BUNGE LIMITED COM USDO.01*	USD 691	719		1 410	59 201	0,02	
BURLINGTON STORES COM USDO.0001*	USD 307	274		581	110 010	0,03	207
CAPITAL ONE FINL COM USDO.01*	USD 1 974	2 095	582	3 487	230 217	0,07	587
CAPRI HOLDINGS LTD COM NPV*	USD 700	1 589	2 289				
CARDINAL HEALTH INC COM*	USD 1 150	1 363	352	2 161	93 215	0,03	
CARLYLE GROUP INC COM USDO.01*	USD	1 576	600	976	22 122	0,01	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
CARMAX INC COM USD0.50*	USD	843	465		1 308	110 451	0,03	1 308
CARNIVAL CORP COM USD0.01(PAired STOCK)*	USD	1 734	4 394	2 942	3 186	44 434	0,01	3 186
CARNIVAL PLC ORD USD1.66*	GBP	464	435	899				
CARRIER GLOBAL COR COM USD0.01*	USD		6 918	800	6 118	171 663	0,05	
CATERPILLAR INC DEL COM*	USD	2 426	2 350	571	4 205	576 218	0,18	4 205
CBOE GLOBAL MARKET COM USD0.01*	USD	454	480		934	75 291	0,02	
CBRE GROUP INC CLASS 'A' USD0.01*	USD	1 223	1 543	402	2 364	102 015	0,03	475
CELANESE CORP COM SERIES 'A' USD0.0001*	USD	539	620		1 159	114 416	0,04	1 159
CELGENE CORP COM USD0.01*	USD	2 962		2 962				
CENTENE CORP DEL COM*	USD	1 844	3 378	802	4 420	236 871	0,07	
CENTERPOINT ENERGY INC COM*	USD	2 083	2 519		4 602	81 813	0,03	4 602
CF INDS HLDGS INC COM*	USD	796	1 283		2 079	58 659	0,02	
CH ROBINSON WORLDW COM USD0.1*	USD	686	619	353	952	89 380	0,03	952
CHARTER COMMUN INC COM USD0.001 CLASS 'A'*	USD	679	585	133	1 131	648 756	0,21	1 032
CHEVRON CORP COM USD0.75*	USD	8 203	9 039	2 443	14 799	978 954	0,31	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A*	USD	126	91		217	247 957	0,08	217
CHUBB LIMITED ORD CHF24.15*	USD	1 950	1 975	457	3 468	369 984	0,12	
CHURCH & DWIGHT INC COM*	USD	895	1 400	476	1 819	156 609	0,05	
CIGNA CORP COM USD0.25*	USD	1 581	1 902	426	3 057	475 808	0,15	
CISCO SYSTEMS COM USD0.001*	USD	18 393	19 781	5 069	33 105	1 198 055	0,38	
CIT GROUP INC COM NEW USD0.01*	USD	651		651				
CITIGROUP INC COM USD0.01*	USD	9 931	12 081	5 345	16 667	660 135	0,21	
CITIZENS FINL GP COM USD0.01*	USD	1 732	3 360	2 373	2 719	63 151	0,02	
CITRIX SYSTEMS INC COM USD0.001*	USD	619	472	228	863	109 188	0,03	
COGNIZANT TECHNOLO COM CL'A'USD0.01*	USD	2 419	2 196	345	4 270	272 339	0,09	
COMCAST CORP COM CLS'A' USD0.01*	USD	19 442	21 421	4 697	36 166	1 537 105	0,49	36 166
COMERICA INC COM*	USD	712	541		1 253	44 033	0,01	
CONAGRA BRANDS IN COM USD5*	USD	1 772	2 112		3 884	127 428	0,04	2 624
CONCHO RES INC COM USD0.001*	USD	876	1 042	420	1 498	60 722	0,02	
CONOCOPHILLIPS COM USD0.01*	USD	4 733	6 372	2 811	8 294	250 244	0,08	8 294
CONSOLIDATED EDISON INC COM*	USD	1 321	1 333		2 654	189 705	0,06	2 654
CONTINENTAL RES IN COM STK USD0.01*	USD	600		600				
COOPER COS INC COM USD0.10*	USD	248	160		408	126 369	0,04	
CORNING INC COM USD0.50*	USD	3 521	4 730	1 122	7 129	212 278	0,07	7 129
CORTEVA INC COM USD0.01*	USD	3 087	3 173	673	5 587	147 883	0,05	
COSTCO WHSL CORP NEW COM*	USD	1 903	2 052	471	3 484	1 136 328	0,36	
CROWDSTRIKE HOLDIN COM USD0.0005 CL A*	USD		1 152		1 152	145 339	0,05	1 150
CROWN CASTLE INTL COM USD0.01*	USD	1 770	1 686	284	3 172	485 227	0,15	3 172
CROWN HOLDINGS INC COM USD5*	USD	515	1 217	551	1 181	83 396	0,03	
CUMMINS INC COM*	USD	683	602	167	1 118	216 896	0,07	
CVS HEALTH CORP COM STK USD0.01*	USD	5 574	6 645	1 755	10 464	561 446	0,18	
D R HORTON INC COM*	USD	1 496	1 712	586	2 622	182 190	0,06	
DANAHER CORP COM USD0.01*	USD	2 756	2 865	541	5 080	1 004 999	0,32	
DARDEN RESTAURANTS INC COM*	USD	552	465		1 017	94 128	0,03	
DATADOG INC COM USD0.00001 CL A*	USD		1 623	400	1 223	114 790	0,04	
DAVITA INC COM USD0.001*	USD	270	493		763	60 041	0,02	763
DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C*	USD	760	1 012		1 772	110 201	0,03	1 772
DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001*	USD	771	2 958	2 514	1 215	34 136	0,01	1 215
DENTSPLY SIRONA IN COM NPV*	USD	1 135	969	499	1 605	64 484	0,02	
DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01*	USD	729	1 067	648	1 148	31 768	0,01	826
DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01*	USD	1 478	2 017	1 168	2 327	123 530	0,04	2 327
DISH NETWORK CORPO CLASS'A'COM USD0.01*	USD	891	1 271	527	1 635	43 608	0,01	
DOCUSIGN INC COM USD0.0001*	USD	400	1 232	116	1 516	299 792	0,09	70
DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875*	USD	1 147	1 007	228	1 926	370 925	0,12	
DOLLAR TREE INC*	USD	1 062	1 150	436	1 776	149 039	0,05	
DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01*	USD	145	188		333	130 112	0,04	333
DOVER CORP COM*	USD	591	492		1 083	107 799	0,03	
DOW INC COM USD0.01*	USD	3 287	5 238	2 690	5 835	252 231	0,08	
DTE ENERGY CO COM*	USD	832	825	200	1 457	153 995	0,05	
DUPONT DE NEMOURS COM USD0.01*	USD	3 187	2 968	542	5 613	286 107	0,09	
DXC TECHNOLOGY CO COM USD0.01*	USD	1 267	1 072	2 339				
DYNATRACE INC COM USD0.001*	USD		1 258		1 258	47 410	0,01	
E TRADE FINANCIAL COM USD0.01*	USD	842	2 237	980	2 099	96 519	0,03	
EAST WEST BANCORP INC COM*	USD	535	669		1 204	36 216	0,01	77
EASTMAN CHEM CO COM*	USD	700	684	461	923	66 246	0,02	923
EATON CORP PLC COM USD0.01*	USD	1 758	1 816	451	3 123	292 750	0,09	
EATON VANCE CORP COM NON VTG*	USD	336	514	850				
EBAY INC COM USD0.001*	USD	3 251	4 950	2 225	5 976	286 052	0,09	
EDISON INTL COM*	USD	1 580	1 856	694	2 742	128 077	0,04	2 742
ELANCO ANIMAL HEAL COM NPV*	USD	1 456	2 367	843	2 980	76 469	0,02	
ELECTRONIC ARTS INC COM*	USD	1 153	1 276	143	2 286	273 895	0,09	
ELI LILLY AND CO COM NPV*	USD	3 755	4 036	1 016	6 775	921 355	0,29	
EMERSON ELEC CO COM*	USD	2 611	4 107	1 623	5 095	306 935	0,10	5 095
ENTERGY CORP NEW COM*	USD	883	847	236	1 494	135 244	0,04	
EQUINIX INC COM USD0.001 NEW*	USD	370	396	109	657	458 829	0,15	
EQUITABLE HOLDINGS COM USD0.01*	USD		3 790	900	2 890	48 431	0,02	2 890
EQUITABLE HOLDINGS INC*	USD	1 000	1 690	2 690				
ESSENTIAL UTILS IN COM USD0.50*	USD		3 567	1 800	1 767	65 343	0,02	1 767
ESTEE LAUDER COS CLASS'A'COM USD0.01*	USD	931	937	163	1 705	341 882	0,11	
EVEREST RE GROUP COM USD0.01*	USD	200	154	89	265	48 095	0,02	
EVERGY INC COM NPV*	USD	1 086	396		1 482	69 196	0,02	
EVERSOURCE ENERGY COM USD5*	USD	1 417	1 372	276	2 513	192 902	0,06	
EXELON CORP COM NPV*	USD	3 969	4 168	721	7 416	243 649	0,08	
EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001*	USD	638	965	394	1 209	101 846	0,03	861
EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01*	USD	456	668	322	802	78 834	0,02	2
EXXON MOBIL CORP COM NPV*	USD	18 201	19 864	4 721	33 344	1 051 693	0,33	
FACEBOOK INC COM USD0.000006 CL 'A'*	USD	10 352	11 033	2 567	18 818	4 527 999	1,43	
FED REALTY INV TR SBI USD0.01*	USD	316	520		836	56 407	0,02	836
FEDEX CORP COM USD0.10*	USD	1 075	998	168	1 905	440 215	0,14	1 905
FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01*	USD	2 637	2 894	697	4 834	653 795	0,21	
FIFTH THIRD BANCORP COM*	USD	3 267	4 463	2 498	5 232	102 483	0,03	5 232
FIRST REPUBLIC BAN COM USD0.01*	USD	767	720	193	1 294	129 657	0,04	625
FIRSTENERGY CORP COM USD0.10*	USD	2 448	3 732	1 348	4 832	127 455	0,04	4 832
FISERV INC COM USD0.01*	USD	2 565	2 506	675	4 396	416 201	0,13	4 396
FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001*	USD	362	366	80	648	141 753	0,04	
FLUOR CORP NEW COM*	USD	858		858				

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
FORD MOTOR CO COM STK USD0.01*	USD	16 410	15 983		32 393	198 209	0,06	
FORTUNE BRANDS HOME USD0.01 WI*	USD	573	372		945	75 118	0,02	103
FOX CORP COM USD0.01 CL A*	USD	1 676	1 945	1 198	2 423	61 953	0,02	2 423
FOX CORP COM USD0.01 CL B*	USD	623	521		1 144	29 398	0,01	1 144
FREPORT-MCMORAN COM STK USD0.10*	USD	6 456	5 620		12 076	173 523	0,05	307
GARMIN LTD COM CHF10.00*	USD	668	608	224	1 052	91 685	0,03	
GENERAL MLS INC COM*	USD	2 634	3 349	933	5 050	286 176	0,09	5 050
GENERAL MOTORS CO COM USD0.01*	USD	5 447	5 525	1 302	9 670	262 887	0,08	3 857
GENUINE PARTS CO COM STK USD1*	USD	617	417		1 034	90 410	0,03	
GILEAD SCIENCES COM USD0.001*	USD	5 430	6 303	1 608	10 125	587 815	0,19	
GLOBAL PAYMENTS COM NPV*	USD	1 317	1 187	219	2 285	372 801	0,12	2 285
GLOBE LIFE INC COM USD1.00*	USD	511	430	246	695	51 019	0,02	695
GODADDY INC COM CL A USD0.001*	USD	890	389		1 279	89 271	0,03	
GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01*	USD	1 418	1 255	169	2 504	462 342	0,15	2 197
GRAINGER W W INC COM*	USD	238	151		389	127 507	0,04	
HALLIBURTON COM STK USD2.50*	USD	3 350	3 086		6 436	71 253	0,02	6 436
HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01*	USD	1 331	1 951	474	2 808	95 093	0,03	
HASBRO INC COM*	USD	447	803	267	983	74 707	0,02	182
HCA HEALTHCARE INC COM USD0.01*	USD	1 294	1 191	213	2 272	260 257	0,08	
HD SUPPLY INC COM USD0.01*	USD	435	1 095		1 530	57 971	0,02	
HEALTHPEAK PPTYS I COM USD1*	USD		6 045	1 300	4 745	118 360	0,04	4 745
HEALTHPEAK PROPERTIES INC*	USD	1 945		1 945				
HELMERICH & PAYNE COM USD0.10*	USD	600		600				
HERSHEY COMPANY COM USD1.00*	USD	642	597	146	1 093	143 941	0,05	968
HESS CORPORATION COM USD1*	USD	1 236	829		2 065	77 653	0,02	
HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01*	USD	5 154	5 946		11 100	95 556	0,03	11 100
HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01*	USD	1 159	1 524	545	2 138	167 593	0,05	895
HOLLYFRONTIER CORP COM USD0.01*	USD	790	734	1 524				
HOLOGIC INC COM USD0.01*	USD	924	1 404	420	1 908	116 520	0,04	
HOME DEPOT INC COM USD0.05*	USD	4 740	4 726	951	8 515	2 172 569	0,69	
HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586*	USD	1 064	1 378		2 442	109 689	0,03	2 442
HOST HOTELS & RESO COM STK USD0.01*	USD	3 622	4 742	3 112	5 252	52 065	0,02	5 252
HOWMET AEROSPACE I COM USD1.00*	USD		4 419	1 400	3 019	46 376	0,01	3 019
HP INC COM USD0.01*	USD	6 316	6 164	1 668	10 812	188 638	0,06	
HUMANA INC COM USD0.166*	USD	587	508	87	1 008	383 304	0,12	
HUNTINGTON BANCSHARES INC COM*	USD	4 341	4 961	1 834	7 468	62 917	0,02	
HUNTINGTON INGALLS COM USD0.01*	USD	170	95	265				
IAC/INTERACTIVECOR COM USD0.001*	USD		594		594	65 368	0,02	
INGERSOLL RAND INC COM USD1.00*	EUR		2 005	1	2 004	65 556	0,02	2 004
INGERSOLL RAND INC COM USD1.00*	EUR		903		903	29 954	0,01	
INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1*	USD	74	528	602				
INGERSOLL-RAND PLC SHS USD1*	EUR	1 023		1 023				
INGREDION INC COM USD0.01*	USD	452	236		469	32 610	0,01	
INTEL CORP COM USD0.001*	USD	19 245	19 585	5 597	33 233	1 580 989	0,50	27 741
INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20*	USD	3 810	4 235	974	7 071	790 427	0,25	7 071
INTL PAPER CO COM USD1.00*	USD	1 402	2 040	743	2 699	100 527	0,03	
INTUIT INC COM USD0.01*	USD	1 116	1 248	238	2 126	637 174	0,20	170
INVESCO LTD COM STK USD0.20*	USD	2 051	1 316		3 367	35 296	0,01	3 367
IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01*	USD	751	940	125	1 566	226 792	0,07	
IRON MTN INC NEW COM NPV*	USD	1 329	760		2 089	51 417	0,02	2 089
JACOBS ENG GROUP COM USD1*	USD	510	603	1 113				
JAZZ PHARMA PLC COM USD0.0001*	USD	263	242		505	66 157	0,02	
JEFFERIES FINL GRP COM USD0.0001*	USD	383	920	1 303				
JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01*	USD	3 475	4 517	1 152	6 840	256 712	0,08	
JONES LANG LASALLE INC COM*	USD	179	343		522	45 877	0,01	522
KANSAS CITY STHN I COM USD0.01*	USD	381	461	128	714	118 622	0,04	
KELLOGG CO COM USD0.25*	USD	1 064	1 186	366	1 884	111 800	0,04	1 884
KEURIG DR PEPPER COM USD0.01*	USD		3 736	1 200	2 536	64 307	0,02	2 536
KEYCORP NEW COM*	USD	4 717	4 083		8 800	96 454	0,03	
KEYSIGHT TECHNOLOG COM USD0.01 'WD'*	USD	818	617		1 435	130 232	0,04	1 435
KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25*	USD	1 452	1 448	302	2 598	352 452	0,11	2 194
KIMCO REALTY COM USD0.01*	USD	1 383	917		2 300			
KINDER MORGAN INC USD0.01*	USD	8 992	8 508	1 784	15 716	178 034	0,06	
KKR & CO INC COM NPV CLASS A*	USD	2 300	1 972	593	3 679	116 072	0,04	3 679
KLA CORPORATION COM USD0.001*	USD	703	617	124	1 196	212 886	0,07	
KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01*	USD	700	471		1 171	43 787	0,01	800
KOHL'S CORPORATION COM USD0.01*	USD	499	412	911				
KROGER CO COM USD1*	USD	3 407	3 334	689	6 052	188 549	0,06	6 052
L BRANDS INC COM USD0.50*	USD	1 064		1 064				
L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00*	USD	957	906	180	1 683	262 616	0,08	1 568
LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1*	USD	483	342	112	713	123 330	0,04	
LAM RESEARCH CORP COM USD0.001*	USD	623	582	97	1 108	337 713	0,11	
LAS VEGAS SANDS CORP COM*	USD	1 634	2 598	844	3 388	145 240	0,05	687
LEAR CORP COM USD0.01*	USD	325	206		531	53 201	0,02	
LENNAR CORP COM CL'A'USD0.10*	USD	1 461	1 138	527	2 072	155 490	0,05	2 072
LINCOLN NATL CORP COM NPV*	USD	897	2 158	1 364	1 691	48 674	0,02	
LKQ CORP COM*	USD	1 600	888		2 488	63 387	0,02	
LOWE'S COS INC COM USD0.50*	USD	3 421	3 139	729	5 831	888 550	0,28	
LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01*	USD	519	497		1 016	307 450	0,10	
LUMEN TECHNOLOGIES COM USD1.00*	USD	4 978	4 040	2 013	7 005	64 938	0,02	7 005
MACY'S INC COM STK USD0.01*	USD	1 438		1 438				
MANPOWER GROUP COM USD0.01*	USD	300		300				
MARATHON OIL CORP COM USD1*	USD	4 141		4 141				
MARATHON PETROLEUM COM USD0.01*	USD	2 911	2 074		4 985	134 376	0,04	
MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'*	USD	1 225	1 125	206	2 144	182 364	0,06	2 144
MASCO CORP COM*	USD	1 465	1 190	710	1 945	98 516	0,03	
MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'*	USD	3 899	3 783	718	6 964	2 163 671	0,68	
MATCH GRP INC NEW COM NPV*	USD		1 996	1	1 995	202 811	0,06	
MCCORMICK & CO INC COM NVTG NPV*	USD	497	560	132	925	164 955	0,05	925
MCDONALD'S CORP COM USD0.01*	USD	3 280	3 532	937	5 875	1 184 732	0,37	
MCKESSON CORP COM USD0.01*	USD	838	697	307	1 228	168 027	0,05	
MERCK & CO INC COM USD0.50*	USD	11 078	12 683	3 817	19 944	1 519 938	0,48	
METLIFE INC COM USD0.01*	USD	3 407	5 313	2 879	5 841	199 470	0,06	
MGM RESORTS INTL COM STK USD0.01*	USD	2 068	2 319	1 140	3 247	64 884	0,02	3 247
MICROCHIP TECHNOLGY COM USD0.001*	USD	1 143	850	188	1 805	170 411	0,05	1 582
MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10*	USD	4 538	4 588	650	8 476	365 693	0,12	
MICROSOFT CORP COM USD0.0000125*	USD	31 360	33 096	8 251	56 205	10 861 093	3,43	
MID-AMER APARTMENT COM STK USD0.01*	USD	483	583		1 066	113 560	0,04	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MIDDLEBY CORP COM USD0.01*	USD	310		310				
MODERNA INC COM USD0.0001*	USD		2 200		2 200	143 003	0,05	2 200
MOHAWK INDS COM USD0.01*	USD	300	300		600	53 796	0,02	
MOLSON COORS BEVER COM USD0.01 CLASS B*	USD	832	966		1 798	55 438	0,02	1 798
MONDELEZ INTL INC COM USD0.01*	USD	6 161	7 971	2 495	11 637	614 226	0,19	
MORGAN STANLEY COM STK USD0.01*	USD	5 614	6 098	1 990	9 722	431 866	0,14	9 722
MOSAIC CO COM USD0.01*	USD	1 848	1 848	1 423	2 051	34 427	0,01	
MOTOROLA SOLUTIONS COM USD0.01*	USD	688	675		1 363	196 366	0,06	
MSCI INC COM STK USS0.01*	USD	424	259		683	223 882	0,07	
NATIONAL OILWELL VARCO INC COM*	USD	1 635	5 079	2 424	4 290	35 709	0,01	4 290
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC*	USD	709	465		1 174	37 223	0,01	1 174
NEKTAR THERAPEUTICS COM*	USD	900		900				
NETAPP INC COM USD0.001*	USD	1 299	1 913	793	2 419	97 432	0,03	2 419
NETFLIX INC COM USD0.001*	USD	1 883	1 892	350	3 425	1 573 454	0,50	
NEWELL BRANDS INC COM USD1*	USD	1 397	2 751	1 187	2 961	46 682	0,01	2 961
NEWMONT CORPORATIO COM USD1.60*	USD	2 066	4 398	1 220	5 244	305 697	0,10	
NEWMONT CORPORATIO COM USD1.60*	CAD	1 324			1 324	77 352	0,02	
NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07*	EUR	1 822			1 822	23 948	0,01	
NIELSEN HLDGS PLC COM EURO.07*	USD		1 395		1 395	18 174	0,01	1 395
NIKE INC CLASS'B' COM NPV*	USD	5 345	5 736	1 263	9 818	1 132 407	0,36	8 125
NISOURCE INC COM NPV*	USD	1 458	2 037	864	2 631	53 179	0,02	2 631
NOBLE ENERGY INC COM USD0.01*	USD	1 721	2 710	4 431				
NORFOLK STHN CORP COM USD1*	USD	1 123	1 051	193	1 981	389 471	0,12	
NORTHERN TRUST CP COM USD1.666*	USD	1 005	705	230	1 480	106 020	0,03	1 480
NORTONLIFELOCK INC*	USD	2 602		2 602				
NORTONLIFELOCK INC COM USD0.01*	USD		7 802	3 400	4 402	84 284	0,03	4 402
NORWEGIAN CRUISE L COM USD0.001*	USD	1 013	438	1 451				
NRG ENERGY INC COM USD0.01*	USD	1 479	775	544	1 710	48 294	0,02	
NUCOR CORP COM*	USD	1 272	1 326	439	2 159	88 983	0,03	2 159
NVIDIA CORP COM USD0.001*	USD	2 479	2 967	599	4 847	2 410 151	0,76	
NVR INC COM STK USD0.01*	USD	15	8		23	86 281	0,03	
OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20*	USD	3 785	4 486	2 229	6 042	55 566	0,02	6 042
OGE ENERGY CORP COM USD0.01*	USD	641	1 679	552	1 768	48 714	0,02	
OLD DOMINION FGHT LINES INC COM*	USD	291	897	422	766	127 325	0,04	
OMNICOM GROUP INC COM USD0.15*	USD	872	1 040	352	1 560	70 946	0,02	1 560
ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01*	USD	1 700	2 195	948	2 947	58 727	0,02	
ONEOK INC*	USD	1 721	1 874		3 595	85 810	0,03	
ORACLE CORP COM USD0.01*	USD	10 241	11 042	3 610	17 673	969 353	0,31	17 673
OREILLY AUTO NEW COM USD0.01*	USD	335	300	67	568	240 615	0,08	
OTIS WORLDWIDE COR COM USD0.01*	USD		3 509	400	3 109	178 296	0,06	
OWENS CORNING COM STK USD0.01*	USD	476	848	384	940	59 426	0,02	
PACCAR INC COM STK USD1*	USD	1 416	1 566	396	2 586	202 616	0,06	
PACKAGING CORP AMER COM*	USD	400	352		752	75 343	0,02	
PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001*	USD	412	414	80	746	167 749	0,05	
PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50*	USD	586	524	138	972	180 695	0,06	
PARSLEY ENERGY INC COM USD0.01 CL A*	USD	969		969				
PAYCHEX INC COM*	USD	1 527	2 216	1 411	2 332	170 909	0,05	2 332
PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001*	USD	4 888	5 256	1 459	8 685	1 572 170	0,50	
PELOTON INTERACTIV COM USD0.000025 CL A*	USD		1 500		1 500	136 765	0,04	
PENTAIR PLC COM USD0.01*	USD	803	672		1 475	62 026	0,02	
PERRIGO CO LTD COM EURO.001*	EUR	296			296	12 246	0,00	
PERRIGO CO LTD COM EURO.001*	USD	300	921	427	794	33 491	0,01	
PFIZER INC COM USD0.05*	USD	23 909	24 649	5 150	43 408	1 463 636	0,46	
PG&E CORP COM*	USD		7 396		7 396	63 806	0,02	7 396
PHILLIPS 66 COM USD0.01*	USD	2 032	1 817	407	3 442	163 936	0,05	
PINNACLE WEST CAP CORP COM*	USD	597	438		1 035	70 890	0,02	
PINTEREST INC COM USD0.00001 CL A*	USD		3 100		3 100	118 226	0,04	
PLAINS GP HLDGS LP LTD PARTNER INT CL A NEW IN*	USD	382		382				
PNC FINANCIAL SVCS COM USD5*	USD	1 882	1 816	363	3 335	336 768	0,11	3 335
PPL CORP COM USD0.01*	USD	2 961	3 338		6 299	157 470	0,05	6 299
PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01*	USD	1 404	1 100	488	2 016	74 588	0,02	
PROCTER & GAMBLE COM NPV*	USD	10 788	11 165	2 555	19 398	2 477 068	0,78	
PROLOGIS INC COM USD0.01*	USD	2 685	3 856	913	5 628	520 278	0,16	1 000
PRUDENTIAL FINL COM USD0.01*	USD	1 673	2 433	735	3 371	196 728	0,06	1 058
PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM*	USD	2 238	2 096	529	3 805	191 957	0,06	
PVH CORP COM USD1*	USD	293	232	525				
QUALCOMM INC COM USD0.0001*	USD	5 223	4 720	1 159	8 784	949 713	0,30	
QUEST DIAGNOSTICS INC COM*	USD	539	496		1 035	108 869	0,03	
QURATE RETAIL INC COM USD0.01 SERIES A*	USD	1 685		1 685				
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM*	USD	551	481		1 032	68 987	0,02	
RAYTHEON CO COM NEW*	USD	1 192	652	1 844				
RAYTHEON TECHNOLOG COM USD1.00*	USD		14 104	1 900	12 204	645 163	0,20	
REGENCY CENTERS COM USD0.01*	USD	774	493		1 267	44 257	0,01	
REGENERON PHARMACE COM USD0.001*	USD	308	524	63	769	395 495	0,13	
REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM*	USD	3 917	3 021		6 938	73 496	0,02	
REINSURANCE GROUP COM USD0.01*	USD	371	209		580	50 724	0,02	580
RENAISSANCE RE HLG COM USD1*	USD	248	120		368	57 389	0,02	
REPUBLIC SERVICES COM USD0.01*	USD	828	1 536	391	1 973	169 215	0,05	
ROBERT HALF INTL COM USD0.001*	USD	496	661	376	781	37 987	0,01	
ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1*	USD	566	441	139	868	175 987	0,06	
ROSS STORES INC COM USD0.01*	USD	1 571	1 487	354	2 704	231 835	0,07	2 704
ROYAL CARIBBEAN GR COM USD0.01*	USD	718	872	358	1 232	73 268	0,02	1 232
SALESFORCE.COM INC COM USD0.001*	USD	3 546	4 143	778	6 911	1 595 752	0,50	
SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A*	USD	514	412	71	855	250 176	0,08	
SCHEIN HENRY INC COM*	USD	684	348		1 032	55 732	0,02	
SCHLUMBERGER COM USD0.01*	USD	6 002	7 273	2 947	10 328	147 647	0,05	
SCHWAB(CHARLES)CP COM USD0.01*	USD	5 068	6 370	1 532	9 906	329 734	0,10	9 906
SEALED AIR CORP NEW COM*	USD	759	1 358	642	1 475	52 594	0,02	
SEI INVESTMENT COM USD0.01*	USD	487	728	335	880	41 007	0,01	
SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01*	EUR	400			400	15 514	0,00	
SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01*	USD	100	505		605	23 979	0,01	
SERVENOW INC COM USD0.001*	USD	788	775	114	1 449	645 665	0,20	
SIGNATURE BK COM USD0.01*	USD	323	507	359	471	35 912	0,01	391
SIMON PRP GROUP COM USD0.0001*	USD	1 272	1 854	802	2 324	138 103	0,04	681
SIRIUS XM HLDGS IN COM USD0.001*	USD	8 700	3 993	3 324	9 369	46 138	0,01	7 043
SKYWORKS SOLUTIONS INC COM*	USD	732	669	146	1 255	167 766	0,05	
SLACK TECHNOLOGIES COM USD0.0001 CL A*	USD		3 573		3 573	88 173	0,03	3 573
SMUCKER(JM)CO COM NPV*	USD	509	488		997	105 816	0,03	997

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SNAP-ON INC COM USD1*	USD	300	214		514	69 480	0,02	514
SOUTHWEST AIRLINES COM USD1*	USD	806			806	27 769	0,01	
SPECTRUM BRANDS HO COM USD0.01*	USD	10		10				
SPIRIT AEROSYSTEMS COM STK USD0.01 CLASS 'A'*	USD	475		475				
SQUARE INC COM USD0.000001 CL A*	USD	1 523	1 877	494	2 906	433 990	0,14	
STANLEY BLACK & DE COM USD2.50*	USD	699	612	145	1 166	173 759	0,05	566
STARBUCKS CORP COM USD0.001*	USD	5 302	5 642	1 906	9 038	713 451	0,23	
STATE STREET CORP COM STK USD1*	USD	1 463	1 610	436	2 637	143 741	0,05	2 637
STEEL DYNAMICS INC COM*	USD	948	2 591	1 175	2 364	62 182	0,02	
STERIS PLC ORD USD0.001*	USD	300	422		722	116 873	0,04	
SUNTRUST BKS INC COM*	USD	2 012		2 012				
SYNCHRONY FINANCA COM USD0.001*	USD	2 397	1 926		4 323	103 941	0,03	
SYSCO CORP COM USD1*	USD	2 253	1 649	338	3 564	203 735	0,06	3 564
T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20*	USD	1 076	906	148	1 834	216 049	0,07	1 334
T-MOBILE US INC COM USD0.0001*	USD	1 490	3 332	538	4 284	450 112	0,14	4 284
TAPESTRY INC COM USD0.01*	USD	1 138	919	2 057				
TARGET CORP COM STK USD0.0833*	USD	2 151	2 295	590	3 856	557 692	0,18	
TD AMERITRADE HLDG COM USD0.01*	USD	930	1 953	500	2 383	85 714	0,03	
TECHNIPFMC PLC COM USD1*	USD	1 484	936	2 420				
TELEFLEX INC COM*	USD	228	148		376	117 598	0,04	
TESLA INC COM USD0.001*	USD	599	6 461	1 262	5 798	2 285 299	0,72	5 685
TEXAS INSTRUMENTS COM USD1*	USD	3 987	4 242	1 076	7 153	938 390	0,30	
THERMO FISHER SCIE COM USD1*	USD	1 722	1 692	356	3 058	1 240 467	0,39	
TIFFANY & CO NEW COM*	USD	395	480		875	93 133	0,03	481
TJX COS INC COM USD1*	USD	5 149	5 051	1 079	9 121	466 342	0,15	
TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008*	USD	511	519	174	856	112 730	0,04	856
TRADEWEB MARKETS I COM USD0.00001 CL A*	USD		997	400	597	31 813	0,01	588
TRANE TECHNOLOGIES COM USD1*	USD		1 073	295	778	86 668	0,03	
TRANE TECHNOLOGIES COM USD1*	EUR		1 023		1 023	113 522	0,04	
TRANSIGM GROUP INC COM*	USD	215	194		409	178 535	0,06	409
TRAVELERS CO INC COM NPV*	USD	1 213	842		2 055	204 266	0,06	
TRUIST FINANCIAL CORP*	USD	3 310	450	3 760				
TRUIST FINL CORP COM USD5*	USD		11 166	901	10 265	358 848	0,11	
TWITTER INC COM USD0.000005*	USD	3 050	4 057	846	6 261	255 977	0,08	
TYSON FOODS INC CL A*	USD	1 276	1 246	302	2 220	121 317	0,04	
UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001*	USD	800	8 013	1 584	7 229	242 287	0,08	7 229
UGI CORP NEW COM*	USD	887	1 212	617	1 482	44 905	0,01	1 478
ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01*	USD	203	282	90	395	81 284	0,03	14
UNION PACIFIC CORP COM USD2.50*	USD	3 043	2 986	739	5 290	956 825	0,30	
UNITED AIRLINES HO COM USD0.01*	USD	210	196	406				
UNITED RENTALS INC COM*	USD	347	302	118	531	85 131	0,03	531
UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01*	USD	4 082	4 089	774	7 397	2 118 787	0,67	
UNIVERSAL HEALTH S CLASS'B' COM USD0.01*	USD	334	705	334	705	69 319	0,02	
UNUM GROUP COM USD0.10*	USD	1 100		1 100				
US BANCORP COM USD0.01*	USD	6 447	6 321	2 345	10 423	343 304	0,11	
VAIL RESORTS INC COM*	USD	200	139		339	66 642	0,02	
VALERO ENERGY CORP NEW COM*	USD	1 770	1 728	398	3 100	123 381	0,04	3 100
VARIAN MEDICAL SYS COM USD1*	USD	334	447		781	123 418	0,04	
VEREIT INC COM USD0.001*	USD	5 842	3 448		9 290	55 479	0,02	
VERIZON COMMUN COM USD0.10*	USD	17 777	18 614	4 238	32 153	1 757 368	0,56	32 153
VF CORP COM NPV*	USD	1 550	1 480	482	2 548	164 453	0,05	2 548
VIACOM INC NEW CL'B' NON-VTG USD0.001*	USD	1 904		1 904				
VIACOMCBS INC*	USD	1 346		1 346				
VIACOMCBS INC COM USD0.001 CL B*	USD		6 581	1 500	5 081	130 755	0,04	3 699
VISA INC COM STK USD0.0001*	USD	7 445	8 007	2 156	13 296	2 442 774	0,77	13 296
VISTRA CORP COM USD0.01*	USD	1 332	2 059		3 391	58 758	0,02	
VOYA FINL INC COM USD0.01*	USD	573	394		967	42 583	0,01	967
WABCO HOLDINGS INC COM STK USD0.01*	USD	168	308	476				
WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01*	USD	3 471	2 989	748	5 712	188 505	0,06	
WALMART INC COM USD0.10*	USD	6 177	6 852	1 916	11 113	1 428 491	0,45	11 113
WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01*	USD	7 734	8 346	1 984	14 096	1 606 923	0,51	
WASTE MGMT INC DEL COM*	USD	1 761	1 795	350	3 206	333 344	0,11	
WELLS FARGO & CO COM USD1 2/3*	USD	18 392	17 282	5 882	29 792	643 502	0,20	
WELLTOWER INC COM USD1*	USD	1 672	1 809	361	3 120	157 915	0,05	
WESTERN DIGITAL CORP COM*	USD	1 312	1 530	282	2 560	85 966	0,03	2 560
WESTLAKE CHEM CORP COM USD0.01*	USD	200		200				
WESTROCK CO COM USD0.01*	USD	976	1 362		1 660	52 983	0,02	
WEYERHAEUSER CO COM USD1.25*	USD	3 048	3 394	824	5 618	147 207	0,05	
WHIRLPOOL CORP COM*	USD	247	337	148	436	73 662	0,02	436
WILLIAMS COS INC COM USD1*	USD	5 447	5 158	1 605	9 000	162 481	0,05	
WORKDAY INC COM USD0.001 CL A*	USD	686	834	101	1 419	280 466	0,09	
WYNN RESORTS LTD COM*	USD	367	482		849	56 013	0,02	849
XEROX HLDGS CORP COM USD1.00*	USD	734	661	1 395				
XILINX INC COM USD0.01*	USD	1 076	1 041		1 878	179 857	0,06	
XPO LOGISTICS INC COM USD0.001*	USD	380	516	229	667	51 880	0,02	667
XYLEM INC COM USD0.01 WI*	USD	953	688	323	1 318	101 862	0,03	1 318
YUM BRANDS INC COM*	USD	1 253	1 316	343	2 226	186 721	0,06	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01*	USD	890	847	170	1 567	195 998	0,06	
ZIONS BANCORPORATI COM USD0.001*	USD	471	2 322	1 079	1 714	46 014	0,01	93
ZOOM VIDEO COMMUNI COM USD0.001 CL A*	USD		1 400	100	1 300	561 488	0,18	1 300
Total Vereinigte Staaten						163 126 859	51,56	
Total Namensaktien						213 670 513	67,53	
Depository Receipts								
Australien								
JAMES HARDIE ID PLC CUF5 EURO.5*	AUD	1 832	2 321	940	3 213	70 118	0,02	3 000
Total Australien						70 118	0,02	
China								
BEIGENE LTD SPON ADS EACH REPR 13 ORD*	USD	100	300	100	300	78 950	0,02	289
Total China						78 950	0,02	
Frankreich								
SES S.A. FDR EACH REP 1 'A' NPV*	EUR	1 735	1 721	923	2 533	16 527	0,01	
Total Frankreich						16 527	0,01	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Hongkong								
MELCO RESORTS UNSP ARD EACH REP 3 ORD SHS*	USD	700	800		1 500	22 946	0,01	1 500
Total Hongkong						22 946	0,01	
Israel								
TEVA PHARMA IND ADR(CNV 1 ORD ILS0.10)*	USD	4 649	4 500		9 149	75 735	0,02	
Total Israel						75 735	0,02	
Niederlande								
ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS*	EUR	1 453	3 967	2 153	3 267	25 173	0,01	
UNIBAIL-RODAMCO-WE CDI 20:1*	AUD	4 427		4 427				
Total Niederlande						25 173	0,01	
Schweden								
MILLICOM INTL CELL SDR EACH REP 1 USD1.50*	SEK	384	578	962				
Total Schweden							0,00	
Grossbritannien								
AMCOR PLC CDI 1:1*	AUD	6 294		1 808	4 486	45 286	0,01	
MICRO FOCUS INTL SPON ADR EACH REP 1 ORD SHS*	USD	619		619				
Total Grossbritannien						45 286	0,01	
Total Depository Receipts						334 735	0,11	
Investmentzertifikate, closed end								
Kanada								
CANADIAN APARTMENT PROP. REAL ESTATE INVESTMENT TRUST*	CAD		1 000	500	500	15 975	0,01	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST*	CAD	31	879		910	8 800	0,00	
Total Kanada						24 775	0,01	
Singapur								
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST*	SGD	12 450	11 092		23 542	51 336	0,02	
CAPITALAND MALL TRUST*	SGD	17 000			17 000	22 082	0,01	
MAPLETREE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST*	SGD		14 000		14 000	18 279	0,01	14 000
Total Singapur						91 697	0,03	
Grossbritannien								
SEGR0 PLC REIT*	GBP	5 263	4 499	2 081	7 681	85 065	0,03	
Total Grossbritannien						85 065	0,03	
Vereinigte Staaten								
DUKE REALTY CORP REIT*	USD	1 649	2 602	830	3 421	115 978	0,04	
LIBERTY PPTY TST SBI USD0.001*	USD	501	507	1 008				
SL GREEN REALTY CORPORATION*	USD	390		390				
VENTAS INC REIT*	USD	1 576	1 527	517	2 586	99 692	0,03	
Total Vereinigte Staaten						215 671	0,07	
Total Investmentzertifikate, closed end						417 207	0,13	
Investmentzertifikate, open end								
Kanada								
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-CAD*	CAD	300		300				
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST UNITS VARIABLE VOTING*	CAD	200	1 014		1 214	16 700	0,01	1 214
Total Kanada						16 700	0,01	
Total Investmentzertifikate, open end						16 700	0,01	
Anrechte								
Australien								
HARVEY NORMAN HOLDING RIGHTS 11.10.19*	AUD	136		136				
TABCORP HOLDINGS LTD RIGHTS 10.09.20*	AUD		1 110	1 110				
Total Australien							0,00	
Italien								
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA RIGHTS 21.06.20*	EUR		4 882	4 882				
Total Italien							0,00	
Niederlande								
AEGON NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 11.09.20*	EUR		11 502	11 502				
KONINKLIJKE DSM NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 21.08.20*	EUR		1 303	1 303				
KONINKLIJKE DSM NV RIGHTS (STOCK DIVIDEND) 27.05.20*	EUR		1 305	1 305				
KONINKLIJKE PHILIPS NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 07.07.20*	EUR		6 797	6 797				
NN GROUP NV (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 26.08.20*	EUR		2 218	2 218				
Total Niederlande							0,00	
Portugal								
ELECTRICIDADE DE PORTUGAL RIGHTS 06.08.20*	EUR		25 249	25 249				
Total Portugal							0,00	
Singapur								
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST RIGHTS 28.11.19*	SGD		1 992	1 992				
SINGAPORE AIRLINES LTD RIGHTS 28.05.20*	SGD		5 400	5 400				
SINGAPORE AIRLINES LTD RIGHTS 28.05.20*	SGD		10 620	10 620				
Total Singapur							0,00	
Spanien								
ACS ACTIV DE CONST Y SER SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 07.07.20*	EUR		1 880	1 880				
ACS ACTIVIDADES DE CONST (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 03.03.20*	EUR		1 853	1 853				
CELLNEX TELECOM RIGHTS 25.10.19*	EUR		1 088	1 088				
CELLNEX TELECOM SA RIGHTS 07.08.20*	EUR		2 202	2 202				
FERROVIAL SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 20.11.19*	EUR		2 118	2 118				
FERROVIAL SA(STOCK DIVIDEND) RIGHTS 28.05.20*	EUR		3 325	3 325				

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
IBERDROLA SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 22.07.20*	EUR		44 875	44 875				
IBERDROLA SA EUR RIGHTS 23/01/20*	EUR		36 797	36 797				
REPSOL SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 07.01.20*	EUR		6 876	6 876				
REPSOL SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 06.07.20*	EUR		13 011	13 011				
TELEFONICA SA RIGHTS 01.07.20*	EUR		39 409	39 409				
Total Spanien							0,00	
Grossbritannien								
WHITBREAD PLC-NIL RIGHTS 09.06.20*	GBP		410	410				
Total Grossbritannien							0,00	
Vereinigte Staaten								
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO CVR RIGHTS 31.12.20*	USD		2 962	2 962				
DISH NETWORK CORP RIGHTS 09.12.19*	USD		48	48				
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM RIGHTS 05.06.20*	USD		203	203				
T-MOBILE US INC RIGHTS 27.07.20*	USD		3 259	3 259				
Total Vereinigte Staaten							0,00	
Total Anrechte							0,00	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						311 284 671	98,39	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Inhaberaktien

Australien

MAGELLAN FINANCIAL NPV**	AUD		1 089		1 089	40 618	0,01	
Total Australien						40 618	0,01	

Kanada

FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST**	CAD	700		700				
Total Kanada							0,00	

Spanien

TELEFONICA SA-WI 20**	EUR		1 642	1 642				
Total Spanien							0,00	

Schweden

KINNEVIK INV AB SER'B'NPV (POST SPLIT)**	SEK	846		846				
Total Schweden							0,00	

Vereinigte Staaten

AON PLC COM USD0.01 CL A**	USD	997	584	1 581				
IAC INTERACTIVECOR COM USD0.001**	USD	334	323	657				
Total Vereinigte Staaten							0,00	

Total Inhaberaktien

40 618 0,01

Vorzugsaktien

Grossbritannien

ROLLS ROYCE HLDGS NON CUM RED PREF GBPO.001 C**	GBP		304 796	304 796				
Total Grossbritannien							0,00	

Total Vorzugsaktien

0,00

Namensaktien

Australien

OIL SEARCH LTD NPV INSTITUTIONAL PLACEMENT**	AUD		969	969				
SYDNEY AIRPORT NPV INSTL ENTITLEMENT OFFER**	AUD		1 487	1 487				
Total Australien							0,00	

Kanada

ENCANNA CORP COM NPV**	CAD	6 212		6 212				
Total Kanada							0,00	

Frankreich

BOLLORE EURO.16 (RFD 01/01/2020)**	EUR		31	31				
Total Frankreich							0,00	

Deutschland

AXEL SPRINGER SE NPV (ASD 02/08/19 TRAVIATA)**	EUR	255		255				
Total Deutschland							0,00	

Portugal

BANCO ESPIRITO SAN NPV**	EUR	27 931			27 931	0	0,00	
Total Portugal						0,00		

Schweden

KINNEVIK AB RED NPV B**	SEK		846	846				
KINNEVIK AB SER'B'NPV (POST SPLIT)**	SEK		1 854	1 854				
KINNEVIK AB SER'B'NPV(RED SHS 11/09/20)**	SEK		1 854	1 854				
Total Schweden							0,00	

Vereinigte Arabische Emirate

NMC HEALTH PLC ORD GBPO.1**	GBP	246	611		857	0	0,00	
Total Vereinigte Arabische Emirate							0,00	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Vereinigte Staaten								
ARCONIC INC COM USD1.00**	USD	1 514	2 265	3 779				
QIAGEN NV NPV (ASSD THERMO FISHER)**	EUR		992	992				
Total Vereinigte Staaten							0,00	
Total Namensaktien							0,00	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						40 618	0,01	
Total Wertschriften						311 325 289	98,40	
(davon ausgeliehen)						65 563 914	20,72	
Bankguthaben auf Sicht						4 648 639	1,47	
Derivative Finanzinstrumente						3 132	0,00	
Sonstige Vermögenswerte						412 584	0,13	
Gesamtfondsvermögen						316 389 644	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-716 602		
Andere Verbindlichkeiten						-275 903		
Nettofondsvermögen						315 397 139		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	311 287 803	98,39
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	40 618	0,01
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	311 328 421	98,40

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basisiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.20*	14	EUR	481 758	-16 064	-0,01
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.20*	2	GBP	138 766	-4 662	0,00
S&P500 EMINI FUTURE 18.12.20*	19	USD	2 925 668	19 255	0,01
S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.20*	1	CAD	132 267	-63	0,00
TOPIX INDX FUTURE 10.12.20*	2	JPY	283 034	4 666	0,00
			3 961 493	3 132	0,00

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 3 961 493

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Optionen/Warrants auf Aktien/Aktienbaskets			
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP CALL WARRANT 22.00000 20-03.08.27	USD	1 945	1 945
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.03.20	EUR	5	5
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.19	EUR	2	5
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.12.20	EUR	14	0
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 19.06.20	EUR	11	11
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.09.20	EUR	14	14
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.03.20	GBP	2	2
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.19	GBP	1	1
FTSE 100 INDEX FUTURE 19.06.20	GBP	5	5
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.09.20	GBP	5	5
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.12.20	GBP	2	0
S&P500 EMINI FUTURE 19.06.20	USD	17	17
S&P500 EMINI FUTURE 20.12.19	USD	4	7
TOPIX INDX FUTURE 12.12.19	JPY	0	1
S&P500 EMINI FUTURE 20.03.20	USD	8	8
S&P500 EMINI FUTURE 18.09.20	USD	18	18
S&P500 EMINI FUTURE 18.12.20	USD	19	0
S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 18.06.20	CAD	1	1
S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.09.20	CAD	1	1
TOPIX INDX FUTURE 10.09.20	JPY	2	2
S&P/TSX 60 INDEX FUTURE 17.12.20	CAD	1	0
TOPIX INDX FUTURE 10.12.20	JPY	2	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
JPY	12 000 000	CHF	110 851	04.10.2019
CHF	390 051	HKD	3 100 000	27.12.2019
CHF	21 780	HKD	175 000	03.01.2020
CHF	14 918	AUD	22 000	03.01.2020
CHF	872 240	USD	900 000	03.01.2020
CHF	49 119	JPY	5 500 000	03.02.2020
CHF	46 005	AUD	70 000	03.02.2020
JPY	5 000 000	CHF	44 849	24.03.2020
AUD	30 000	CHF	16 988	23.03.2020
JPY	8 000 000	CHF	70 696	01.04.2020
JPY	10 000 000	USD	93 752	07.05.2020
HKD	2 200 000	CHF	267 630	26.06.2020
CHF	453 567	USD	480 000	06.07.2020
JPY	35 000 000	CHF	306 033	09.07.2020

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	3 961 492,08	1,26%
Total engagement- reduzierende Positionen	–	–

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
Klasse I-A1: 0,3125% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
Klasse I-A1: 0,40% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1: 0,32%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF	0.658514	JPY 1 = CHF	0.008706
CAD 1 = CHF	0.687816	NOK 1 = CHF	0.098193
DKK 1 = CHF	0.144736	NZD 1 = CHF	0.607294
EUR 1 = CHF	1.077372	SEK 1 = CHF	0.102654
GBP 1 = CHF	1.187760	SGD 1 = CHF	0.673028
HKD 1 = CHF	0.118548	USD 1 = CHF	0.918750
ILS 1 = CHF	0.268617		

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		456 040 404.77	516 113 628.48	391 476 051.20
Klasse I-A1	CH0023989582			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 041.38	1 063.47	1 031.86
Anzahl Anteile im Umlauf		430 978,7700	448 196,7700	321 255,0000
Klasse I-A2	CH0219870471			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 018.77	1 040.02	1 009.72
Anzahl Anteile im Umlauf		7 095,0000	37 949,0000	59 408,0000

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	-1.3%	3.9%	-0.8%
Klasse I-A2	CHF	-1.5%	3.7%	-1.0%
Referenzindex: Swiss Bond Index Foreign AAA – BBB	CHF	-1.3%	3.8%	-0.7%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Die Rendite des Auslandsegments fiel in der Berichtsperiode ebenfalls negativ aus, allerdings weniger ausgeprägt als für das Inlandsegment. Das Auslandsegment war wegen dem höheren Kreditrisiko zwar stärker von der Ausweitung der Kreditspannen betroffen, dafür hatte der Anstieg der Zinssätze aufgrund der tieferen Duration einen geringeren Effekt. Aus relativer Sicht ist das Ergebnis ebenfalls ausgeglichen. Das höhere Kreditrisiko führte auch hier zu einem negativen Ergebnisbeitrag, was aber durch die höhere laufende Rendite, den Beitrag der Zinskurve und durch die Titelselektion kompensiert werden konnte.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	16,25
Frankreich	12,57
Vereinigte Staaten	12,16
Deutschland	6,45
Supranational	6,21
Kanada	5,16
Australien	4,36
Grossbritannien	3,80
Südkorea	3,76
Niederlande	3,69
Übrige	23,46
Total	97,87

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	8 835 936.23 ¹	19 671 554.05 ²
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	446 412 117.07	501 196 299.27
Derivative Finanzinstrumente	-576 965.61	-967 067.88
Sonstige Vermögenswerte	1 470 465.42	1 910 495.60
Gesamtfondsvermögen	456 141 553.11	521 811 281.04
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-5 543 381.00
Andere Verbindlichkeiten	-101 148.34	-154 271.56
Nettofondsvermögen	456 040 404.77	516 113 628.48

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	17 498.38	0.00
Negativzinsen	-38 300.15	-52 884.26
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	2 930 627.89	3 287 566.85
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	178 061.49	345 397.85
Erträge der Effektenleihe	47 719.00	65 310.80
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	175 766.14	1 045 918.26
Total Ertrag	3 311 372.75	4 691 309.50
Aufwand		
Passivzinsen	-4 000.28	-2 982.44
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-333 742.97	-283 528.14
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-61 010.53	-161 868.32
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-36 268.30	-33 955.38
Sonstige Aufwendungen	-389.00	-264.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-327 543.64	-470 250.65
Total Aufwand	-762 954.72	-952 848.93
Nettoertrag	2 548 418.03	3 738 460.57
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1 230 872.43	990 550.58
Realisierter Erfolg	1 317 545.60	4 729 011.15
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-8 958 737.75	13 678 754.47
Gesamterfolg	-7 641 192.15	18 407 765.62

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	2 548 418.03	3 738 460.57
Vortrag des Vorjahres	109 020.05	164 853.14
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2 657 438.08	3 903 313.71
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-2 614 252.62	-3 794 293.66
Vortrag auf neue Rechnung	43 185.46	109 020.05

¹ Zum 30. September 2020 wurden gegenüber Zürcher Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 550 000 und gegenüber Basler Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 350 000 als Sicherheiten hinterlegt.

² Zum 30. September 2019 wurden gegenüber Zürcher Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 550 000 und gegenüber Basler Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 350 000 als Sicherheiten hinterlegt.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	516 113 628.48	391 476 051.20
Ordentliche Jahresausschüttung	-3 730 578.16	-2 689 172.50
Saldo aus dem Anteilverkehr	-48 701 453.40	108 918 984.16
Gesamterfolg	-7 641 192.15	18 407 765.62
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	456 040 404.77	516 113 628.48

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	448 196,7700	321 255,0000
Ausgegebene Anteile	56 638,0000	234 728,7700
Zurückgenommene Anteile	-73 856,0000	-107 787,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	430 978,7700	448 196,7700
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-17 218,0000	126 941,7700
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	37 949,0000	59 408,0000
Ausgegebene Anteile	250,0000	13 106,0000
Zurückgenommene Anteile	-31 104,0000	-34 565,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	7 095,0000	37 949,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-30 854,0000	-21 459,0000

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	6.0975
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	6.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-2.1000
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	3.9000
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	6.0000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	4.1635
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	4.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-1.4000
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	2.6000
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	4.0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Notes, fester Zins							
CHF							
AT&T INC-REG-S 1.37500% 14-04.12.24*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 107 000	0,46	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 2.37500% 12-05.03.24*	CHF	650 000		650 000	713 050	0,16	
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.37500% 13-15.03.23*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 568 250	0,34	
EBN BV 1.12500% 12-04.07.24*	CHF	250 000		250 000	262 250	0,06	
KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY JSC 3.63800% 14-20.06.22*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 078 000	0,67	
LGT BANK AG 1.50000% 14-10.05.21*	CHF	700 000		700 000	708 610	0,16	
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF		1 070 000	1 070 000	1 075 885	0,24	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF-REG-S 0.12500% 19-06.12.32*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 013 000	0,22	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25000% 15-30.04.25*	CHF	1 550 000		1 550 000	1 576 350	0,35	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-21.01.30*	CHF		2 000 000	2 000 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 18-16.11.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 062 600	0,45	100 000
PFANDBRIEFBK SCHZ HYPO INST-REG-S 0.37500% 18-10.07.28*	CHF	6 000 000		1 000 000	5 000 000	1,14	2 665 000
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.00000% 11-06.12.21*	CHF	2 200 000		2 200 000	2 254 120	0,49	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.62500% 14-16.05.24*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 678 400	0,37	
RZD CAP PLC/RUSSIAN RAILWAYS-REG-S 0.89800% 19-03.10.25*	CHF	600 000		600 000	583 800	0,13	
SULZER AG-REG-S 0.80000% 20-23.09.25*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 011 000	0,44	
Total CHF					25 911 815	5,68	
Total Notes, fester Zins					25 911 815	5,68	
Notes, Nullcoupon							
CHF							
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.10.30*	CHF	4 000 000	1 000 000	3 000 000	3 000 000	0,66	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-30.03.26*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 051 000	0,67	
Total CHF					6 051 000	1,33	
Total Notes, Nullcoupon					6 051 000	1,33	
Medium-Term Notes, fester Zins							
CHF							
ABN AMRO BANK NV 0.30000% 16-18.12.24*	CHF	500 000		500 000	510 500	0,11	
ABN AMRO BANK NV 3.37500% 06-15.08.31*	CHF	500 000		500 000	685 500	0,15	
ACCOR SA-REG-S 1.75000% 14-27.06.22*	CHF	2 865 000	1 865 000	1 000 000	990 500	0,22	
ACHMEA BANK NV 0.50000% 17-27.10.23*	CHF	300 000		300 000	302 550	0,07	
ACHMEA BANK NV 0.50000% 17-03.10.25*	CHF	2 250 000		2 250 000	2 262 375	0,50	15 000
ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 0.37500% 18-23.01.23*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 996 000	0,44	475 000
ADCB FINANCE CAYMAN LTD 0.72500% 18-15.02.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 009 630	0,22	
AFRICA FINANCE CORP REG-S 1.20500% 20-30.09.25*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 004 000	0,44	
AKADEMISKA HUS AB 0.25000% 15-17.11.25*	CHF	1 000 000	1 000 000				
AKADEMISKA HUS AB 0.30000% 17-08.10.29*	CHF	500 000		500 000	525 750	0,12	
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.75000% 18-19.12.22*	CHF	400 000	400 000				
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.80000% 19-18.07.23*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 002 000	0,44	35 000
AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24*	CHF		1 500 000	1 500 000			
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN 0.25000% 16-25.10.23*	CHF	900 000		900 000	913 500	0,20	900 000
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF	2 300 000		2 300 000	2 344 850	0,51	
AROUNDTOWN SA-REG-S 0.73200% 18-30.01.25*	CHF	350 000		350 000	350 525	0,08	210 000
ASB FINANCE LTD 0.20000% 17-02.08.24*	CHF	2 350 000	1 500 000	3 850 000	3 901 975	0,86	
ASB FINANCE LTD/LONDON-REG-S 0.45000% 19-30.01.25*	CHF	1 350 000		1 350 000	1 381 050	0,30	
AUCHAN HOLDING SA-REG-S 1.50000% 14-03.06.24*	CHF	500 000	500 000				
AUCKLAND COUNCIL 1.12500% 13-07.02.24*	CHF	1 500 000	1 500 000				
AUCKLAND COUNCIL 1.50000% 14-28.11.25*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 316 400	0,29	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.25000% 19-24.09.29*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	952 500	0,21	10 000
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 452 750	0,32	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE 0.57500% 17-07.04.27*	CHF	1 300 000	500 000	800 000	772 000	0,17	140 000
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.24000% 19-06.06.25*	CHF	3 300 000	300 000	2 170 000	1 430 000	0,30	50 000
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.38400% 19-27.09.24*	CHF	2 500 000		2 500 000			
BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.20000% 19-19.11.27*	CHF		500 000	500 000			
BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT AG 0.01000% 16-15.09.21*	CHF	300 000	300 000				
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.25250% 19-12.06.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 015 000	0,44	425 000
BANK OF MONTREAL-REG-S 0.05000% 18-30.12.22*	CHF	2 400 000		2 400 000	2 416 800	0,53	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.20000% 18-19.11.25*	CHF	3 400 000	1 000 000	4 400 000	4 505 600	0,99	
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 0.20000% 20-19.11.25*	CHF		1 000 000	1 000 000			
BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.30000% 15-16.09.22*	CHF	2 100 000		2 100 000	2 126 250	0,47	35 000
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.32000% 17-10.02.25*	CHF	350 000		350 000	355 600	0,08	
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.25000% 19-10.07.25*	CHF	500 000		500 000	506 750	0,11	500 000
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 19-12.06.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 009 500	0,22	355 000
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.20000% 20-03.11.28*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 014 000	0,44	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT 0.55000% 15-08.12.23*	CHF	1 460 000		1 460 000	1 496 500	0,33	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.40000% 17-19.12.25*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 430 100	0,31	585 000
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.60000% 17-05.04.27*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 345 500	0,29	
BANQUE FEDERTIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.36600% 18-10.10.24*	CHF	500 000		500 000	509 000	0,11	500 000
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA 0.55000% 16-11.10.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 006 500	0,22	75 000
BANQUE INTL A LUXEMBOURG SA-REG-S 1.00000% 19-10.07.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 009 500	0,22	
BARCLAYS PLC-REG-S 1.12500% 18-12.07.23*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 632 000	0,36	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.62500% 14-08.09.21*	CHF	2 370 000		2 370 000	2 382 324	0,52	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 14-08.09.26*	CHF	800 000		800 000			
BERLIN HYP AG 0.25000% 20-11.09.28*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 029 000	0,44	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD 3.00000% 14-20.12.19*	CHF	550 000	550 000				
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 513 500	0,33	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.75000% 19-03.09.27*	CHF	2 300 000	1 000 000	1 300 000	1 338 350	0,29	409 080
BNP PARIBAS 1.87500% 12-12.09.22*	CHF	250 000		250 000			
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.30000% 19-15.10.27*	CHF		1 000 000	1 000 000	978 000	0,21	1 000 000
BNP PARIBAS SA-REG-S 0.15000% 20-10.03.28*	CHF	1 600 000	1 200 000	400 000	386 400	0,08	
BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25*	CHF	1 875 000		1 875 000	1 929 375	0,42	500 000
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 1.37500% 14-03.02.21*	CHF	1 300 000	1 300 000				
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.25000% 15-24.06.22*	CHF	1 500 000	1 500 000				
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.11100% 20-24.07.28*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 010 000	0,44	2 000 000
BORAL LTD 2.25000% 13-20.02.20*	CHF	1 975 000	1 975 000				

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
BOS FUNDING LTD-REG-S 1.50000% 19-29.11.23*	CHF		1 700 000		1 700 000	0,36	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 0.75000% 14-27.09.21*	CHF	2 700 000			2 700 000	0,60	
BPCE SA-REG-S 0.50000% 19-08.11.23*	CHF	1 650 000			1 650 000	0,37	
CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 2.37500% 11-19.04.23*	CHF	350 000	350 000				
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE/CAD 0.12500% 15-22.12.25*	CHF	1 350 000			1 350 000	1 381 725	0,30
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.15000% 18-31.07.23*	CHF	400 000			400 000	404 600	0,09
CANADIAN IMPERIAL BANK-REG-S 0.05000% 19-15.10.26*	CHF	500 000			500 000	500 500	0,11
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMER-REG-S 0.10000% 20-24.10.23*	CHF		500 000		500 000	508 000	0,11
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM-REG-S 0.10000% 18-30.04.25*	CHF	3 500 000	1 000 000	2 500 000	2 552 500	0,56	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.69700% 18-22.03.21*	CHF	1 000 000	565 000	435 000	434 592	0,10	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 1.11500% 18-17.10.22*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 514 531	0,33	185 000
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.38000% 19-19.10.23*	CHF		1 000 000	1 000 000	994 375	0,22	
CELLNEX TELECOM SA 1.11750% 20-17.07.25*	CHF		3 200 000	1 000 000	2 200 000	2 218 700	0,49
CENTRAL AMERICAN BANK ECO INTEGRAT 1.87500% 14-25.02.22*	CHF	150 000		150 000			
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 0.19400% 15-19.11.21*	CHF	2 250 000	1 250 000	1 000 000	1 004 900	0,22	
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 0.37100% 16-26.08.22*	CHF	400 000		400 000			
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.31400% 18-05.09.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.20000% 19-25.03.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 511 250	0,33	
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.40500% 20-25.06.25*	CHF		2 500 000	500 000	2 000 000	2 042 000	0,45
CITIGROUP INC 0.50000% 17-22.11.24*	CHF	1 800 000		650 000	1 150 000	1 167 825	0,26
CITIGROUP INC 3.12500% 06-27.09.21*	CHF	3 100 000		1 100 000	2 000 000	2 064 000	0,45
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26*	CHF	2 000 000		500 000	1 500 000	1 545 750	0,34
CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 19-01.11.28*	CHF		5 500 000	4 000 000	1 500 000	1 508 250	0,33
COMMERZBANK AG-REG-S 1.10000% 18-11.07.25*	CHF	1 000 000	1 000 000				
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.50000% 14-07.02.22*	CHF	500 000		500 000	513 200	0,11	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.40000% 17-25.09.26*	CHF	2 750 000		2 750 000	2 839 375	0,62	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 0.11300% 19-10.12.29*	CHF		2 000 000	2 000 000	1 998 000	0,44	100 000
COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 2.50000% 06-24.02.31*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 537 000	0,56	680 000
CORP ANDINA DE FOMENTO 1.37500% 13-11.02.21*	CHF	300 000	300 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.50000% 13-13.08.20*	CHF	250 000	250 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.00000% 14-05.02.24*	CHF	500 000	1 000 000	500 000	1 000 000	1 053 000	0,23
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.50000% 14-01.12.28*	CHF	1 200 000		700 000	500 000	523 750	0,11
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.50000% 15-26.02.26*	CHF	2 050 000	2 050 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45000% 15-07.09.23*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 606 400	0,35	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.15000% 16-24.02.22*	CHF	700 000		700 000	700 980	0,15	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.30400% 16-16.09.24*	CHF	850 000	850 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.51000% 16-16.09.26*	CHF	500 000	500 000				
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.70000% 20-04.09.25*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 006 000	0,44	
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.63000% 18-25.10.23*	CHF	250 000	250 000				
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.50000% 15-16.03.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 051 000	0,23	310 000
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.25000% 15-18.06.26*	CHF	1 650 000		1 650 000	1 705 275	0,37	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.25000% 17-27.07.27*	CHF	350 000		350 000	361 900	0,08	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 18-08.12.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 031 000	0,23	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.50000% 18-03.10.28*	CHF	350 000	350 000				
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.45000% 19-24.01.29*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 576 500	0,35	
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 19-24.10.29*	CHF	3 000 000	1 000 000	2 000 000	2 069 000	0,45	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 2.12500% 14-30.10.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 093 500	0,24	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 14-08.10.21*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 013 500	0,22	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 15-15.09.23*	CHF	500 000		500 000	512 000	0,11	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.00000% 15-27.01.25*	CHF	500 000		500 000	524 250	0,11	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.55000% 16-14.12.26*	CHF	550 000		550 000	567 875	0,12	375 000
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	250 000		250 000	253 303	0,06	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.20000% 18-30.10.23*	CHF	3 050 000		3 050 000	3 086 600	0,68	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 19-07.11.25*	CHF	1 600 000	1 600 000				
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.12750% 20-27.07.28*	CHF		500 000	500 000			
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF		1 000 000	1 000 000			
CREDIT AGRICOLE SALONDON-REG-S-SUB 0.25000% 19-10.10.29*	CHF	1 000 000		1 000 000			
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 1.00000% 15-14.04.23*	CHF	3 700 000		500 000	3 200 000	3 275 200	0,72
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY-REG-S 0.62500% 15-21.08.20*	CHF	3 450 000		3 450 000			
CREDIT SUISSE GUERNSEY LTD 3.12500% 10-12.11.30*	CHF	200 000		200 000			
CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 1.00000% 14-24.09.21*	CHF	2 900 000		900 000	2 000 000	2 026 800	0,44
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.25000% 18-14.11.22*	CHF	1 000 000		1 000 000			
DANSKE BANK AS-REG-S 0.62500% 19-24.11.22*	CHF	1 400 000	1 400 000				
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.45000% 17-08.11.30*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 660 000	0,36	481 953
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 18-18.07.28*	CHF	1 450 000		1 450 000	1 525 081	0,33	420 000
DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.50000% 19-19.06.34*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 052 500	0,23	
DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 17-21.03.22*	CHF	2 000 000	500 000	1 500 000	1 503 750	0,33	460 000
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.80000% 20-07.02.25*	CHF		1 600 000	1 200 000	400 000	390 400	0,09
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG-S 0.43500% 20-06.02.32*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 524 000	0,33	300 000
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 515 000	0,33	
DVB BANK SE 0.57500% 15-17.06.22*	CHF	200 000	200 000				
DZ BANK GENOSSENSCHAFTSBANK AG-SUB 3.23800% 13-30.08.23*	CHF	350 000		350 000	369 775	0,08	
EBN BV 1.62500% 11-03.10.23*	CHF	1 350 000		1 350 000	1 424 250	0,31	
EKSPORTFINANS ASA 2.25000% 11-11.02.21*	CHF	500 000		500 000	504 250	0,11	
ELECTRICITE DE FRANCE 0.30000% 16-14.10.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 522 500	0,33	
ELECTRICITE DE FRANCE 0.65000% 16-13.10.28*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 248 600	0,27	180 000
ELI LILLY & CO-REG-S 0.15000% 16-24.05.24*	CHF	500 000		500 000	508 750	0,11	
ELI LILLY & CO-REG-S 0.45000% 16-24.05.28*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 575 000	0,56	700 000
EMIRATES NBD PJSC 0.62500% 18-09.02.23*	CHF	2 300 000	1 000 000	3 300 000	3 314 850	0,73	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.55000% 17-03.09.24*	CHF	2 400 000		500 000	1 900 000	1 926 600	0,42
ENGIE SA 1.12500% 12-09.10.20*	CHF	400 000		400 000			1 585 446
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.50000% 12-02.08.24*	CHF		500 000	500 000	539 750	0,12	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 0.17000% 17-18.07.25*	CHF	2 050 000	2 000 000	4 050 000			
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.25300% 18-06.03.23*	CHF	1 265 000	1 265 000				
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.40100% 19-02.10.24*	CHF	750 000		750 000	745 078	0,16	750 000
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 0.20500% 19-04.12.25*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	1 990 000	0,44
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.85000% 13-25.10.19*	CHF	2 500 000	2 500 000				
GLENCORE CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 1.00000% 20-30.03.27*	CHF		2 500 000	2 500 000	2 510 000	0,55	
GLENCORE FINANCE EUROPE SA 2.12500% 13-23.12.19*	CHF	1 200 000	1 200 000				
GLENCORE FINANCE EUROPE SA 1.25000% 14-01.12.20*	CHF	1 100 000		1 100 000	1 101 980	0,24	
GLENCORE FINANCE EUROPE SA 2.25000% 16-10.05.21*	CHF	800 000		800 000	810 080	0,18	
GLENCORE FINANCE EUROPE LTD-REG-S 0.35000% 19-10.09.25*	CHF	2 500 000	2 500 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.55000% 16-09.09.21*	CHF	350 000		350 000	352 065	0,08	350 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.50000% 17-04.12.24*	CHF	1 250 000	1 250 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.00000% 18-24.11.25*	CHF	2 150 000		1 150 000	1 000 000	1 037 000	0,23
GRAND CITY PROPERTIES SA-REG-S 0.95600% 18-01.09.26*	CHF	2 000 000		500 000	1 500 000	1 526 250	0,33
HEATHROW FUNDING LTD 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	2 700 000		1 700 000	1 000 000	978 500	0,21
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.45000% 19-15.10.26*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 908 000	0,42	1 040 000

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
HENKEL AG & CO KGAA 0.27250% 20-28.04.23*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 531 250	0,55	
HOLCIM OVERSEAS FINANCE LTD 3.37500% 11-10.06.21*	CHF	900 000	900 000				
HYPONOE GRUPPE BANK AG 0.20000% 17-31.03.22*	CHF	500 000		500 000	502 085	0,11	
HYPONOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 994 000	0,44	
HYPONORARLBERG BANK AG 0.12500% 16-06.10.21*	CHF	1 260 000		1 260 000	1 263 780	0,28	
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S 0.45000% 18-05.03.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 513 500	0,33	
HYPONORARLBERG BANK-REG-S 0.25000% 18-12.11.25*	CHF	350 000		350 000	358 225	0,08	
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S 0.12500% 19-03.09.29*	CHF	960 000	960 000				
HYPONORARLBERG BANK AG-REG-S 0.12500% 20-27.03.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	973 000	0,21	1 000 000
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.69500% 18-27.06.23*	CHF	1 500 000	1 500 000				
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.73250% 19-26.02.24*	CHF	1 350 000	1 350 000				
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.26000% 20-11.02.25*	CHF	700 000	700 000				
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.75250% 20-06.07.23*	CHF	2 000 000	2 000 000				
ICICI BANK LTD/DUBAI 2.75000% 13-07.01.20*	CHF	350 000	350 000				
INDUSTRIAL BANK OF KOREA-REG-S 0.02190% 19-16.07.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 498 125	0,33	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 3.25000% 07-28.06.24*	CHF	2 650 000	650 000	2 000 000	2 269 000	0,50	
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC-REG-S 0.25000% 19-30.09.24*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 356 600	0,30	
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND 0.37500% 17-18.07.25*	CHF	2 950 000	500 000	2 450 000	2 491 650	0,55	
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.30000% 18-18.12.23*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 521 750	0,33	
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 0.12500% 20-14.07.28*	CHF	2 500 000	500 000	2 000 000	1 979 000	0,43	
JPMORGAN CHASE & CO 0.50000% 15-04.12.23*	CHF	2 500 000	500 000	2 000 000	2 044 000	0,45	
JPMORGAN CHASE & CO 0.45000% 16-11.11.26*	CHF	400 000		400 000	409 800	0,09	337 797
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 1.12500% 14-06.11.20*	CHF	1 200 000	1 200 000				
KIWI BANK LTD-REG-S 0.25000% 18-18.10.23*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 414 700	0,31	505 000
KOMMUNALKREDIT AUSTRIA AG 2.50000% 06-14.02.22*	CHF	500 000		500 000	517 000	0,11	
KOREA EXPRESSWAY CORP 0.25000% 17-07.06.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 007 000	0,22	20 000
KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO-REG-S 0.05000% 19-19.07.27*	CHF	500 000	500 000				
KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 0.19250% 20-15.06.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 515 469	0,33	
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.26250% 20-30.07.27*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 055 440	0,89	1 400 000
KOREA WATER RESOURCES CORP-REG-S 0.15000% 18-20.09.23*	CHF	1 850 000		1 850 000	1 858 094	0,41	
KOREA WESTERN POWER CO LTD-REG-S 0.12500% 19-27.02.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
LANSFORSÄKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.20000% 18-17.04.26*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 550 250	0,34	
LGT BANK AG-REG-S 0.37500% 19-05.07.28*	CHF	1 000 000	1 000 000				
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25*	CHF	2 000 000	2 000 000				
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.35000% 18-05.02.27*	CHF	1 400 000	1 400 000				
MACQUARIE BANK LTD 0.62500% 15-04.09.23*	CHF	1 000 000	1 000 000				
MANITOBA, PROVINCE OF-REG-S 0.25000% 19-15.03.29*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 548 750	0,34	
MBANK SA-REG-S 0.56500% 18-07.06.22*	CHF	750 000	750 000				
MBANK SA-REG-S 1.01830% 19-04.10.24*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 383 375	0,30	
MCDONALD'S CORP 0.17000% 16-04.10.24*	CHF	2 050 000	1 000 000	1 050 000	1 061 550	0,23	
MEDIOBANCA INTERNATIONAL LUX SA-REG-S 0.55000% 18-02.03.23*	CHF	300 000		300 000	298 200	0,07	300 000
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.00000% 14-19.09.22*	CHF	1 400 000	1 400 000				
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.30000% 17-19.01.26*	CHF	1 750 000	750 000	1 000 000	1 020 000	0,22	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 19-11.06.27*	CHF	2 500 000	1 500 000	1 000 000	1 005 000	0,22	875 000
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.12500% 20-25.09.28*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 500 750	0,33	
MFINANCE FRANCE SA 1.00500% 17-28.03.23*	CHF	1 250 000	750 000	500 000	502 500	0,11	50 000
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.35000% 18-12.12.23*	CHF	2 350 000		2 350 000	2 372 325	0,52	5 000
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.50000% 18-14.06.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 055 500	0,23	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.55000% 19-15.03.34*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 082 500	0,24	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 19-10.05.30*	CHF	500 000	500 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.20000% 19-18.06.31*	CHF	1 000 000	500 000	1 500 000	1 554 750	0,34	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.12500% 19-18.11.27*	CHF	2 000 000	2 000 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.20000% 19-18.06.31*	CHF	500 000	500 000				
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.10000% 20-17.12.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 990 000	0,44	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 16-19.01.23*	CHF	3 800 000		3 800 000	3 845 600	0,84	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 18-13.03.24*	CHF	1 000 000	500 000	500 000	507 250	0,11	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.12500% 19-21.06.27*	CHF	1 000 000	1 000 000				
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.06500% 20-29.01.29*	CHF	500 000		500 000	499 250	0,11	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.16750% 19-11.07.31*	CHF	1 625 000		1 625 000	1 660 750	0,36	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.12500% 19-13.09.23*	CHF	1 800 000	1 000 000	800 000	793 600	0,17	
NESTLE HOLDINGS INC 0.25000% 17-04.10.27*	CHF	500 000	500 000				
NESTLE HOLDINGS INC 0.55000% 17-04.10.32*	CHF	750 000		750 000	792 750	0,17	750 000
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 19-18.10.27*	CHF	4 000 000	4 000 000				
NORDEA BANK ABP 0.25000% 15-27.11.23*	CHF	3 000 000	500 000	2 500 000	2 542 500	0,56	
NORDEA BANK ABP 0.55000% 15-23.06.25*	CHF	3 150 000	650 000	2 500 000	2 587 500	0,57	85 000
NORSKE TOG-REG-S 1.12500% 13-02.05.23*	CHF	500 000		500 000	514 750	0,11	
ONTARIO, PROVINCE OF 0.25000% 17-28.06.29*	CHF	2 000 000	1 000 000	3 000 000	3 102 000	0,68	
ORANGE SA-REG-S 0.20000% 19-24.11.25*	CHF	1 700 000		1 700 000	1 709 350	0,37	20 000
ORANGE SA-REG-S 0.62500% 19-22.06.29*	CHF	400 000		400 000	407 800	0,09	
PETROLEOS MEXICANOS 1.50000% 15-08.12.20*	CHF	1 400 000	1 400 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 16-17.05.40*	CHF	500 000		500 000	518 000	0,11	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-18.09.26*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 548 000	0,34	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.75000% 17-18.10.38*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 125 700	0,25	
POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 14-17.09.21*	CHF	3 750 000	1 750 000	2 000 000	2 033 125	0,45	
POWSZECZNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK-REG-S 0.30000% 17-02.11.21*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 802 160	0,40	
QUEBEC, PROVINCE OF 1.50000% 14-05.02.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
RABOBANK NEDERLAND NV 2.00000% 10-16.09.21*	CHF	500 000		500 000	512 450	0,11	
RABOBANK NEDERLAND NV 1.12500% 14-08.04.21*	CHF	1 500 000	1 500 000				
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 0.25000% 19-25.11.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 998 000	0,44	
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	984 500	0,22	
RCI BANQUE SA 0.50000% 17-20.04.22*	CHF	800 000		800 000	795 200	0,17	
RCI BANQUE SA 0.50000% 19-18.07.24*	CHF	2 500 000	2 000 000	500 000	493 250	0,11	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.10000% 18-18.07.23*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 011 000	0,22	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.50000% 15-05.10.20*	CHF	1 250 000	1 250 000				
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.60000% 16-23.03.21*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 009 600	0,44	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.62500% 18-24.10.22*	CHF	1 250 000		1 250 000	1 260 000	0,28	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.37500% 15-21.08.23*	CHF	3 500 000		3 500 000	3 563 000	0,78	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.87500% 15-21.08.28*	CHF	2 550 000		2 550 000	2 729 775	0,60	265 000
SNCF RESEAU 3.25000% 06-30.06.32*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 799 200	0,39	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 19-08.10.26*	CHF	600 000		600 000	580 500	0,13	
SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.25000% 20-25.02.27*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 542 400	0,34	
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.70000% 18-26.02.25*	CHF	2 600 000	600 000	2 000 000	2 006 000	0,44	
SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 0.22700% 20-18.06.30*	CHF	1 500 000	1 500 000				250 000
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.87500% 14-02.12.20*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 002 100	0,22	
SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.30000% 16-16.09.22*	CHF	200 000		200 000	201 700	0,04	200 000
SPAREBANK 1 NORD NORGE-REG-S 0.12500% 19-11.12.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 494 000	0,33	
STATNETT SF 2.37500% 11-08.02.21*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 010 000	0,22	1 000 000
TELEFONICA EMISIONES SAU 3.45000% 12-14.12.22*	CHF	1 000 000	1 000 000				

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TELEFONICA EMISIONES SAU 2.59500% 13-23.10.20*	CHF	2 650 000		2 650 000	2 653 710	0,58	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24*	CHF	3 900 000		3 900 000	4 093 050	0,90	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 0.50000% 15-01.06.27*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 553 250	0,34	1 495 000
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.62500% 16-23.06.23*	CHF	2 150 000		2 150 000	2 183 325	0,48	
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.65000% 16-02.11.26*	CHF	500 000	500 000	500 000	500 750	0,11	500 000
TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY-REG-S 1.00000% 18-08.12.25*	CHF	1 450 000		1 450 000	1 483 350	0,33	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 0.37500% 17-31.05.23*	CHF	2 250 000		750 000	1 518 000	0,33	
VERIZON COMMUNICATIONS INC-REG-S 1.00000% 17-30.11.27*	CHF	3 000 000		500 000	2 623 750	0,58	
VINCI SA 3.00000% 12-24.01.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 031 500	0,23	
VODAFONE GROUP PLC 0.37500% 16-03.12.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 016 500	0,22	
VODAFONE GROUP PLC 0.50000% 16-19.09.31*	CHF	500 000					
VODAFONE GROUP PLC 0.62500% 17-15.03.27*	CHF	1 750 000		750 000	1 027 000	0,23	
WELLS FARGO & CO 0.37500% 15-02.06.22*	CHF	2 400 000		2 400 000			
WELLS FARGO & CO-REG-S 1.25000% 14-03.09.24*	CHF	400 000		400 000			
WELLS FARGO & CO-REG-S 0.50000% 15-02.11.23*	CHF	2 100 000		2 100 000			
WELLS FARGO & CO-REG-S 0.75000% 20-27.05.25*	CHF		1 000 000	1 000 000			
WESTPAC BANKING CORP 0.50000% 15-02.02.22*	CHF	500 000		500 000	505 600	0,11	
WESTPAC BANKING CORP 0.40000% 15-09.06.23*	CHF	500 000		500 000	508 750	0,11	50 000
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.50000% 18-16.05.28*	CHF	1 000 000		1 000 000			
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.37500% 16-05.02.24*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 629 600	0,36	
WOODSIDE FINANCE LTD 1.00000% 16-11.12.23*	CHF	600 000		600 000			
Total CHF					288 265 685	63,20	

Total Medium-Term Notes, fester Zins

288 265 685 63,20

Medium-Term Notes, Nullcoupon

CHF

BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 0.00000% 19-24.09.21*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 373 313	0,30	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.00000% 19-27.05.25*	CHF		1 000 000	1 000 000			
KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO-REG-S 0.00000% 19-19.07.24*	CHF	1 500 000		1 500 000			
KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24*	CHF		2 500 000	500 000	2 000 000	1 998 750	0,44
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 0.00000% 19-11.07.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 526 250	0,33	600 000
Total CHF					4 898 313	1,07	

Total Medium-Term Notes, Nullcoupon

4 898 313 1,07

Anleihen, fester Zins

CHF

AMGEN INC 0.41000% 16-08.03.23*	CHF	6 350 000		6 350 000	6 438 900	1,41	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN 0.25000% 17-22.09.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 524 750	0,33	996 287
APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24*	CHF	4 350 000		1 850 000	2 500 000	2 583 750	0,57
APPLE INC-REG-S 0.75000% 15-25.02.30*	CHF	2 400 000		400 000	2 000 000	2 162 000	0,47
AT&T INC-REG-S 1.87500% 14-04.12.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 110 000	0,24	
AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 563 750	0,34	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.12500% 20-27.08.26*	CHF		3 000 000	3 000 000	2 914 500	0,64	1 200 000
BANCO DE CHILE 0.56800% 18-21.11.23*	CHF	300 000		300 000			
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.25000% 15-17.06.20*	CHF	350 000		350 000			
BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S 0.50000% 20-06.12.24*	CHF		3 000 000	1 000 000	2 000 000	1 845 000	0,40
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.87500% 18-14.12.21*	CHF	1 250 000		1 250 000			
BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA-REG-S 0.45000% 19-18.12.23*	CHF	1 500 000		1 000 000	500 000	471 406	0,10
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.37500% 15-19.05.22*	CHF	300 000		300 000	300 450	0,07	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.12500% 17-20.07.27*	CHF	1 500 000		1 500 000			
BANK CLER AG-REG-S 0.50000% 17-28.11.25*	CHF	700 000		700 000			
BASEL-STADT, CANTON OF 0.50000% 15-23.02.35*	CHF	500 000		500 000			
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BK-REG-S 0.45000% 19-13.06.23*	CHF		2 200 000	2 200 000	2 162 600	0,47	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.75000% 14-28.02.24*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 676 000	0,37	30 000
CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.75000% 13-26.06.25*	CHF	150 000	500 000	650 000	715 000	0,16	
CARIBBEAN DEVELOPMENT BANK 0.29700% 16-07.07.28*	CHF	1 500 000		500 000	1 000 000	1 019 500	0,22
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 1.12500% 14-24.02.23*	CHF	450 000		450 000			
COCA-COLA CO/THE 1.00000% 15-02.10.28*	CHF	1 750 000		750 000	1 000 000	1 079 500	0,24
COCA-COLA CO/THE-REG-S 0.25000% 15-22.12.22*	CHF	2 550 000		2 550 000	2 581 875	0,57	290 000
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.30000% 17-07.04.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	985 000	0,22	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.25000% 20-16.06.28*	CHF		2 500 000	1 000 000	1 500 000	1 548 000	0,34
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.12500% 19-05.06.23*	CHF	1 000 000		1 000 000			
DH SWITZERLAND FINANCE SA-REG-S 0.50000% 15-08.12.23*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	2 034 000	0,45
DH SWITZERLAND FINANCE SA-REG-S 1.12500% 15-08.12.28*	CHF	500 000		500 000			
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 2.87500% 05-04.02.30*	CHF	1 000 000		1 000 000			
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 3.00000% 06-15.05.26*	CHF		1 500 000	500 000	1 000 000	1 190 000	0,26
FCA CAPITAL SUISSE SA 0.20000% 17-24.07.20*	CHF	2 600 000		2 600 000			
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.10000% 19-23.10.23*	CHF	800 000		800 000	778 800	0,17	
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.75000% 16-30.11.21*	CHF	4 000 000		1 000 000	3 000 000	3 080 625	0,68
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM 2.25000% 17-19.07.22*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 037 500	0,45	
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S 1.45000% 18-06.03.23*	CHF	3 050 000		3 050 000	3 061 438	0,67	250 000
GENERAL ELECTRIC CO 3.12500% 04-06.12.19*	CHF	3 000 000		3 000 000			
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.40000% 16-28.04.36*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 034 500	0,23	818 981
GS CALTEX CORP-REG-S 0.63300% 18-31.01.24*	CHF	850 000		850 000	852 975	0,19	30 000
KEB HANA BANK-REG-S 0.40750% 18-14.09.23*	CHF	350 000		350 000	351 313	0,08	
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.87500% 20-21.04.25*	CHF		1 000 000	1 000 000	1 040 000	0,23	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.00000% 17-11.12.23*	CHF	800 000		800 000	836 400	0,18	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 1.00000% 18-11.12.24*	CHF	500 000		500 000	515 750	0,11	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC 0.05000% 17-30.03.20*	CHF	1 000 000		1 000 000			
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-REG-S 0.61700% 17-30.09.24*	CHF	350 000		350 000	357 000	0,08	
MONDELEZ INTL 0.62500% 15-06.10.20*	CHF	200 000		200 000			
MONDELEZ INTL 1.12500% 15-21.12.23*	CHF	250 000		250 000	258 375	0,06	
MONDELEZ INTL-REG-S 0.62500% 15-30.12.21*	CHF	500 000		500 000	503 750	0,11	
MONDELEZ INTL-REG-S 1.12500% 15-30.12.25*	CHF	1 980 000		1 980 000			
MONDELEZ INTL-REG-S 0.65000% 16-26.07.22*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 618 400	0,35	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 20-18.09.28*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 020 000	0,44	
NANT DE DRANCE SA 2.00000% 16-02.02.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 070 000	0,23	25 000
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.30000% 17-31.10.25*	CHF	450 000		450 000			
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 0.20000% 16-07.11.31*	CHF	1 750 000		750 000	1 000 000	1 023 000	0,22
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 0.25000% 17-19.01.29*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 444 800	0,32	
NIEDEROESTERREICH, LAND 0.35000% 15-22.09.23*	CHF	1 000 000		1 000 000			
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.20000% 17-26.10.27*	CHF	350 000		350 000	354 725	0,08	350 000
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.30000% 18-24.07.26*	CHF	850 000		850 000	872 100	0,19	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.20000% 20-28.11.28*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 043 000	0,45	

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.55000% 20-27.05.33*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 123 000	0,68	
OESTERREICHISCHE KONTRÖLLBANK AG 2.62500% 06-22.11.24*	CHF	500 000		500 000	566 500	0,12	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 14-19.03.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 043 700	0,23	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 16-08.07.39*	CHF	500 000		500 000	529 950	0,12	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-23.09.32*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 015 700	0,22	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 17-06.05.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 021 600	0,22	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-27.04.26*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 545 900	0,34	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYP INST-REG-S 0.50000% 18-22.01.29*	CHF	1 960 000		1 960 000	2 067 408	0,45	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-17.06.41*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 092 500	0,24	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-07.06.28*	CHF	2 700 000		2 700 000	2 763 990	0,61	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 20-17.06.41*	CHF	1 000 000	1 000 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-12.02.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 069 500	0,23	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 15-14.02.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 064 000	0,45	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-16.07.29*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 067 200	0,23	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-17.07.24*	CHF	1 500 000	1 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-25.02.26*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 558 250	0,56	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL 0.25000% 16-11.02.28*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 066 800	0,45	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.60000% 16-11.12.35*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 628 550	0,36	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 16-02.12.24*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 041 800	0,45	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 18-16.04.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 532 250	0,34	95 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.30000% 19-09.04.29*	CHF	1 500 000	1 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 20-23.04.32*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 037 000	0,45	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 3.12500% 06-15.09.26*	CHF	2 150 000		2 150 000	2 559 575	0,56	
RZD CAPITAL PLC 2.10000% 17-02.10.23*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 548 750	0,34	
RZD CAPITAL PLC LPN 0.84000% 20-12.03.26*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 883 000	0,63	900 000
SLOVAKIA, REPUBLIC OF 2.12500% 13-16.10.23*	CHF	2 000 000	2 000 000				
SPAREBANK 1 SMN 0.35000% 16-05.04.23*	CHF	750 000		750 000	754 125	0,17	
SULZER AG 0.37500% 16-11.07.22*	CHF	1 500 000	1 000 000	500 000	500 000	0,11	
SULZER AG-REG-S 0.62500% 18-22.10.21*	CHF	500 000		500 000	502 800	0,11	
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF	500 000	500 000				
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA 2.12500% 16-15.11.19*	CHF	2 000 000	2 000 000				
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.37500% 17-10.11.20*	CHF	150 000		150 000	149 550	0,03	105 000
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 1.00000% 19-03.12.21*	CHF	1 000 000	1 000 000				
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 0.60000% 20-07.11.22*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 620 563	0,36	
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 0.16600% 19-21.12.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 005 000	0,44	
UBS AG/LONDON-REG-S 0.17000% 20-13.05.22*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 520 000	0,55	
UBS GROUP AG-REG-S 0.75000% 16-22.02.22*	CHF	1 000 000	1 000 000				
UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26*	CHF	400 000		400 000	423 200	0,09	200 000
VIFOR PHARMA AG-REG-S 0.75000% 18-13.09.22*	CHF	700 000	700 000				
Total CHF					107 362 592	23,54	
Total Anleihen, fester Zins					107 362 592	23,54	
Anleihen, Nullcoupon							
CHF							
BALOISE HOLDING-REG-S 0.00000% 19-25.09.29*	CHF	2 000 000	2 000 000				
INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 86-26.11.21*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 014 600	0,44	
KOREA GAS CORP-REG-S 0.00000% 19-28.11.23*	CHF	2 000 000	2 000 000				
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.00000% 19-04.10.24*	CHF	2 000 000	2 000 000	3 000 000	2 995 313	0,66	170 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.00000% 16-05.07.22*	CHF	1 000 000	1 000 000				
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 537 500	0,56	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 15-25.07.23*	CHF	1 500 000	1 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.00000% 16-27.01.27*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 062 000	0,89	
RHAETISCHE BAHN STAMM 0.00000% 16-01.09.31*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 012 000	0,22	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.07.29*	CHF	1 300 000		1 300 000	1 301 300	0,29	
Total CHF					13 922 713	3,05	
Total Anleihen, Nullcoupon					13 922 713	3,05	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					446 412 117	97,87	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					446 412 117	97,87	34 955 479 7,66
Bankguthaben auf Sicht					8 835 936	1,94	
Derivative Finanzinstrumente					-576 966	-0,13	
Sonstige Vermögenswerte					1 470 466	0,32	
Gesamtfondsvermögen					456 141 553	100,00	
Andere Verbindlichkeiten					-101 148		
Nettofondsvermögen					456 040 405		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	446 412 117	97,87
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	-576 966	-0,13
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	445 835 151	97,74

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basismitteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
BKB/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.0825% 17-05.06.24**	4 000 000	CHF	4 000 000	-282 509	-0.06
BKB/INTEREST RATE SWAP RECEIVER 6ML 17-05.06.24	4 000 000	CHF			
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.90500% 17-12.09.24**	2 000 000	CHF	2 000 000	-126 474	-0.03
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP RECEIVER 6ML 17-12.09.24	2 000 000	CHF			
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP PAYER -0.17000% 18-11.12.23**	10 000 000	CHF	10 000 000	-167 983	-0.04
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 18-11.12.23	10 000 000	CHF			
			16 000 000	-576 966	-0.13

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	–	–
Total engagement- reduzierende Positionen	15 449 502,73	3,39%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,0725% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,2625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,20% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,30% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,08%
Klasse I-A2:	0,27%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		808 051 840.58	958 909 528.85	734 963 822.50
Klasse I-A1	CH0023989624			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		947.38	944.96	900.04
Anzahl Anteile im Umlauf		571 708,0000	736 430,0000	606 538,0000
Klasse I-A2	CH0324001301			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 000.40	998.05	950.14
Anzahl Anteile im Umlauf		87 142,0000	72 008,0000	24 089,0000
Klasse I-A3	CH0384999642			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 042.72	1 039.77	991.32
Anzahl Anteile im Umlauf		171 908,0790	183 832,3820	167 622,6210

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	1.7%	6.7%	-1.6%
Klasse I-A2	CHF	1.4%	6.4%	-1.9%
Klasse I-A3	CHF	1.6%	6.6%	-0.9%
Referenzindex:				
Barclays Global Aggregate Treasuries ex CH in CHF (CHF hedged)	CHF	1.4%	7.3%	-1.7%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Die absolute Rendite des Anlagefonds war aufgrund des Rückgangs der Marktzinsen positiv. Ebenso konnte relativ zur Benchmark eine Outperformance erzielt werden. Der Anlagefonds profitierte dank der längeren USD-Duration vom Zinsrückgang in den USA. Weiter trugen die längere Duration in Yen, sowie in geringerem Ausmass auch in Euro, positiv zur relativen Rendite bei. Das Exposure gegenüber SSA-Emittenten erwies sich zunächst als nachteilig. Die Corona-Krise führte zu einer erheblichen Spread-Ausweitung, welche für «Sovereigns» um die 260 Basispunkte und für «Local Authorities» um die 175 Basispunkte betrug. Das schnelle Eingreifen der Notenbanken führte zu einer Beruhigung, gefolgt von einer starken Einengung der Spreads. Der Anlagefonds profitierte daher ab April von dem höheren Kreditrisiko. Nach der guten Performance in allen Hauptwährungen wurden die Risiken stark reduziert. Dank dem USD-Untergewicht sowie dem Entscheid, in kleinere Währungsmärkte nicht zu investieren, konnten zudem die Absicherungskosten tief gehalten werden.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten	21,90
Japan	21,77
Deutschland	8,44
Italien	6,22
Supranational	6,02
Kanada	4,50
Frankreich	3,84
Spanien	3,06
Grossbritannien	2,73
Australien	2,35
Übrige	9,75
Total	90,58

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	72 256 658.60	85 027 032.18
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	759 368 861.49	820 133 219.61
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	54 808 072.09
Derivative Finanzinstrumente	3 425 965.68	684 524.08
Sonstige Vermögenswerte	3 286 151.71	3 689 234.29
Gesamtfondsvermögen	838 337 637.48	964 342 082.25
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-29 806 026.67	-4 873 038.48
Andere Verbindlichkeiten	-479 770.23	-559 514.92
Nettofondsvermögen	808 051 840.58	958 909 528.85

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	46 249.94	35 371.82
Negativzinsen	-340 626.33	-119 859.92
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	0.00	-6 039.78
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	9 663 495.11	10 033 707.22
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	1 621 362.97	2 781 816.28
Erträge der Effektenleihe	107 405.25	193 400.18
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	981 188.45	2 260 723.85
Total Ertrag	12 079 075.39	15 179 119.65
Aufwand		
Passivzinsen	15 665.82	31 397.34 ¹
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-957 617.67	-848 957.94
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-290 005.58	-277 434.08
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A3	-436 970.23	-433 763.43
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-68 830.78	-62 799.61
Sonstige Aufwendungen	-3 692.95	-1 461.37
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-2 291 982.81	-749 671.08
Total Aufwand	-4 033 434.20	-2 342 690.17
Nettoertrag	8 045 641.19	12 836 429.48
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	41 804 755.46	5 603 242.35
Realisierter Erfolg	49 850 396.65	18 439 671.83
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-36 577 811.95	38 779 972.93
Gesamterfolg	13 272 584.70	57 219 644.76

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	8 045 641.19	12 836 429.48
Vortrag des Vorjahres	170 607.45	89 676.94
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8 216 248.64	12 926 106.42
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-8 089 725.79	-12 755 498.97
Vortrag auf neue Rechnung	126 522.85	170 607.45

¹ Die Passivzinsen per 30.9.2019 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 120 031.03

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	958 909 528.85	734 963 822.50
Ordentliche Jahresausschüttung	-13 030 224.13	-12 679 409.68
Saldo aus dem Anteilverkehr	-151 100 048.84	179 405 471.27
Gesamterfolg	13 272 584.70	57 219 644.76
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	808 051 840.58	958 909 528.85

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	736 430,0000	606 538,0000
Ausgegebene Anteile	183 126,0000	306 525,0000
Zurückgenommene Anteile	-347 848,0000	-176 633,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	571 708,0000	736 430,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-164 722,0000	129 892,0000
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	72 008,0000	24 089,0000
Ausgegebene Anteile	55 998,0000	75 497,0000
Zurückgenommene Anteile	-40 864,0000	-27 578,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	87 142,0000	72 008,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	15 134,0000	47 919,0000
Klasse I-A3		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	183 832,3820	167 622,6210
Ausgegebene Anteile	17 364,7000	19 170,4590
Zurückgenommene Anteile	-29 289,0030	-2 960,6980
Bestand Ende Berichtsperiode	171 908,0790	183 832,3820
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-11 924,3030	16 209,7610

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	10.0685
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	10.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-3.5000
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	6.5000
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	10.0000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	7.9026
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	7.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-2.6250
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	4.8750
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	7.5000

Klasse I-A3

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	10.3039
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	10.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-3.5000
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	6.5000
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	10.0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Notes, fester Zins							
CAD							
BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 3.300000% 13-18.12.23*	CAD	2 000 000		2 000 000	1 497 870	0,18	
Total CAD					1 497 870	0,18	
EUR							
ALBERTA, PROVINCE OF-REG-S 0.500000% 20-16.04.25*	EUR		4 500 000	4 500 000			
BELGIUM, KINGDOM OF 5.000000% 04-28.03.35*	EUR	500 000	500 000	1 000 000	1 873 158	0,22	
BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 4.000000% 12-28.03.32*	EUR	1 000 000	3 000 000	4 000 000	6 414 933	0,77	
BNG BANK NV-REG-S 0.050000% 20-02.04.25*	EUR		3 000 000	3 000 000			
METROPOLITANO DE LISBOA SARL 4.061000% 06-04.12.26*	EUR		500 000	500 000	671 007	0,08	
MEXICO, UNITED STATES OF 1.625000% 19-08.04.26*	EUR	2 000 000		2 000 000			
MEXICO, UNITED STATES OF 1.125000% 20-17.01.30*	EUR		600 000	600 000			
NIEDERSACHSEN, STATE OF-REG-S 0.010000% 20-13.08.30*	EUR		5 000 000	5 000 000	5 519 055	0,66	
OEBB-INFRASTRUKTUR AG-REG-S 1.000000% 14-18.11.24*	EUR	1 200 000		1 200 000			
Total EUR					14 478 152	1,73	
GBP							
EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.625000% 00-07.06.32*	GBP		1 000 000	1 000 000	1 846 095	0,22	
INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 0.750000% 20-12.12.24*	GBP		2 000 000	2 000 000	2 425 185	0,29	800 000
Total GBP					4 271 280	0,51	
JPY							
DEVELOPMENT BANK OF JAPAN 1.700000% 02-20.09.22*	JPY		1 500 000 000	1 500 000 000			
Total JPY						0,00	
USD							
ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.125000% 17-11.10.27*	USD	2 000 000		2 000 000			
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 3.750000% 19-30.10.29*	USD		1 500 000	1 500 000			
ALBERTA, PROVINCE OF 3.300000% 18-15.03.28*	USD	5 000 000		5 000 000			
BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.500000% 16-06.05.21*	USD		5 000 000	5 000 000	4 668 398	0,56	811 000
BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 4.700000% 19-22.10.31*	USD		2 000 000	2 000 000			
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.375000% 19-05.02.49*	USD	1 000 000		1 000 000			
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.000000% 19-30.09.29*	USD	3 700 000		3 700 000			
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.700000% 19-30.01.50*	USD	2 000 000		2 000 000			
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.375000% 12-15.06.22*	USD	5 000 000		1 000 000	4 000 000	3 867 497	0,46
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 3.250000% 19-11.02.22*	USD	7 200 000		7 200 000	6 822 711	0,81	500 000
CPIB CAPITAL INC-REG-S 0.375000% 20-29.07.25*	USD		1 500 000	1 500 000		0,00	
DEXIA CREDIT LOCAL DE FRANCE-REG-S 2.375000% 17-20.09.22*	USD	2 000 000		2 000 000			
EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 5.000000% 17-25.01.47*	USD	500 000		500 000			
ICELAND, REPUBLIC OF-REG-S 5.875000% 12-11.05.22*	USD	5 700 000	1 000 000	1 000 000	5 700 000	5 610 831	0,67
JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 1.750000% 20-23.01.23*	USD		300 000	300 000	284 154	0,03	300 000
KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 0.875000% 20-12.03.25*	USD		3 600 000	3 600 000			
KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 1.125000% 20-14.06.30*	USD		4 800 000	3 800 000	1 000 000	931 116	0,11
KOREAN AIR LINES CO LTD-REG-S 2.000000% 19-04.09.22*	USD	4 600 000		4 600 000	4 304 171	0,51	
KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.500000% 17-20.03.27*	USD		2 000 000	2 000 000			
LITHUANIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.125000% 11-09.03.21*	USD	5 000 000		5 000 000	4 705 723	0,56	
NEW BRUNSWICK, PROVINCE OF 3.625000% 18-24.02.28*	USD	4 000 000		3 000 000	1 000 000	1 075 495	0,13
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.400000% 12-26.10.22*	USD	1 000 000		736 000	264 000	250 888	0,03
PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.750000% 17-19.06.32*	USD	1 500 000		1 500 000			
TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 3.500000% 12-15.12.42*	USD		500 000	500 000	590 178	0,07	
Total USD					33 111 161	3,95	
Total Notes, fester Zins					53 358 463	6,36	
Notes, Nullcoupon							
EUR							
CAISSE CENTRALE CREDIT IMMOB-REG-S 0.000000% 20-17.01.24*	EUR		600 000	600 000			
LUXEMBOURG, GRAND DUCHY OF-REG-S 0.000000% 20-28.04.25*	EUR		10 000 000	10 000 000			
NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK NV-REG-S 0.000000% 20-14.04.23*	EUR		5 000 000	5 000 000			
Total EUR						0,00	
Total Notes, Nullcoupon						0,00	
Notes, variabler Zins							
USD							
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3M LIBOR+87.5BP 17-25.01.22*	USD	4 000 000		4 000 000	3 694 882	0,44	
INTL BK FR RCNS & DEV WRD BK OVR NT SONION+30BP 19-06.08.24*	USD		5 000 000	5 000 000	4 589 616	0,55	
Total USD					8 284 497	0,99	
Total Notes, variabler Zins					8 284 497	0,99	
Medium-Term Notes, fester Zins							
EUR							
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.250000% 16-21.07.26*	EUR		2 000 000	2 000 000			
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.500000% 20-25.05.30*	EUR		10 000 000	10 000 000			
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 3.750000% 12-15.02.27*	EUR		2 000 000	2 000 000			
AGENCE FRANCE LOCALE-REG-S 0.500000% 17-20.06.24*	EUR		3 000 000	3 000 000			
AGENCE FRANCE LOCALE-REG-S 1.125000% 18-20.06.28*	EUR	5 000 000		5 000 000			
AGENCE FRANCE LOCALE-REG-S 0.125000% 19-20.06.26*	EUR		2 000 000	2 000 000			
ALBERTA, PROVINCE OF-REG-S 0.625000% 19-16.01.26*	EUR	4 000 000		4 000 000	4 478 102	0,53	400 000
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.750000% 18-20.02.28*	EUR		4 000 000	4 000 000			
AUTOBAHNEN- & SCHNELLSTRASSEN AG-REG-S 2.750000% 12-11.06.32*	EUR	300 000		300 000			
BNG BANK NV-REG-S 0.750000% 19-24.01.29*	EUR	2 200 000		2 200 000			
CHINA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.500000% 16-01.06.21*	EUR	2 000 000		2 000 000	2 161 478	0,26	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.875000% 14-29.05.21*	EUR	1 600 000	2 000 000	3 600 000	3 925 144	0,47	562 000

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.625000% 19-20.11.26*	EUR		1 500 000	1 500 000				
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 0.250000% 20-06.04.27*	EUR		4 500 000		4 500 000	4 977 873	0,59	
CZECH REPUBLIC 3.875000% 12-24.05.22*	EUR	1 000 000		1 000 000				
DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 0.250000% 17-02.06.22*	EUR	4 000 000		4 000 000				
DEXIA CREDIT LOCAL SA-REG-S 0.625000% 19-17.01.26*	EUR	7 000 000		7 000 000				
EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.950000% 18-14.02.28*	EUR	4 000 000		4 000 000				
EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.125000% 16-22.04.24*	EUR	2 000 000		2 000 000				
EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.750000% 17-15.03.27*	EUR	2 000 000		2 000 000				
EUROPEAN UNION 0.300000% 19-13.11.34*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 089 330	0,13	
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA-REG-S 0.300000% 19-06.03.22*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 071 447	0,13	1 000 000
FINNVERA OYJ-REG-S 0.500000% 16-13.04.26*	EUR		4 000 000	4 000 000				
FMS WERTMANAGEMENT 0.375000% 15-29.04.30*	EUR	1 200 000		1 200 000				
HESSEN, STATE OF-REG-S 0.625000% 17-07.04.27*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 302 887	0,27	
ICELAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.500000% 17-20.12.22*	EUR		1 000 000		1 000 000	1 089 417	0,13	
INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.625000% 16-14.06.23*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 530 350	0,54	
ISRAEL, STATE OF-REG-S 2.875000% 14-29.01.24*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 179 723	0,14	
ISRAEL, STATE OF-REG-S 1.500000% 19-16.01.29*	EUR	2 500 000			2 500 000	2 949 306	0,35	2 500 000
JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 0.875000% 14-22.09.21*	EUR	1 500 000		1 500 000				
JUNTA DE EXTREMADURA-REG-S 3.875000% 14-14.03.24*	EUR	700 000		700 000				
KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 0.625000% 16-20.04.26*	EUR	3 500 000		3 500 000				
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.010000% 20-31.03.25*	EUR		6 800 000	6 800 000				
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 1.125000% 17-15.09.32*	EUR	4 000 000		4 000 000				
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.050000% 19-29.09.34*	EUR		3 000 000		3 000 000	3 304 606	0,39	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.010000% 19-05.05.27*	EUR		5 000 000	5 000 000				
LA POSTE SA-REG-S 0.375000% 19-17.09.27*	EUR		2 000 000	2 000 000				
LA POSTE-REG-S 2.750000% 12-26.11.24*	EUR		2 000 000		2 000 000	2 390 534	0,29	
LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.500000% 19-28.02.29*	EUR	7 600 000		7 600 000				
MEXICO, UNITED STATES OF 2.375000% 14-09.04.21*	EUR	500 000		500 000				
NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK NV-REG-S 0.250000% 17-07.06.24*	EUR	3 000 000		3 000 000				
NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 0.950000% 18-13.03.28*	EUR	5 000 000		5 000 000				
POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.375000% 12-09.07.24*	EUR	750 000			750 000	917 871	0,11	
POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.000000% 16-25.10.46*	EUR	2 000 000		2 000 000				
ROMANIA-REG-S 2.000000% 19-08.12.26*	EUR	1 200 000		1 200 000				
ROMANIA-REG-S 2.875000% 14-28.10.24*	EUR	2 000 000		2 000 000				
SNCF RESEAU-REG-S 0.875000% 19-22.01.29*	EUR	4 000 000		4 000 000				
SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 0.625000% 20-17.04.30*	EUR		5 000 000	5 000 000				
SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 4.625000% 09-02.02.24*	EUR		1 000 000	1 000 000				
SPAIN, KINGDOM OF 0.450000% 17-31.10.22*	EUR	5 000 000		5 000 000				
SWEDEN, KINGDOM OF-REG-S 0.125000% 18-24.04.23*	EUR	1 200 000		1 200 000				
UNEDIC ASSEO-REG-S 0.500000% 19-20.03.29*	EUR	1 700 000		1 700 000				
UNEDIC ASSEO-REG-S 1.250000% 15-21.10.27*	EUR		3 000 000	3 000 000				
Total EUR						36 368 068	4,34	
GBP								
BNG BANK NV-REG-S 1.000000% 18-17.06.22*	GBP	5 000 000		5 000 000				
DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 1.125000% 20-28.04.23*	GBP		1 900 000		1 900 000	2 290 273	0,27	
DEXIA CREDIT LOCAL DE FRANCE-REG-S 2.125000% 15-12.02.25*	GBP		2 000 000	2 000 000				
EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.875000% 12-08.06.37*	GBP		2 000 000		2 000 000	3 482 289	0,42	500 000
EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.500000% 12-31.10.22*	GBP	4 000 000		4 000 000				
EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.000000% 16-21.09.26*	GBP	4 000 000		2 000 000	2 000 000	2 482 024	0,30	2 000 000
FMS WERTMANAGEMENT-REG-S 1.125000% 19-15.09.21*	GBP	2 700 000		2 700 000				
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 1.750000% 17-15.12.22*	GBP		2 000 000		2 000 000	2 424 515	0,29	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.000000% 00-07.12.28*	GBP		2 000 000		2 000 000	3 438 256	0,41	600 000
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 1.375000% 19-15.12.25*	GBP	4 000 000		4 000 000				
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.875000% 19-15.09.26*	GBP	1 000 000		1 000 000				
LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK-REG-S 0.875000% 19-15.12.26*	GBP	1 000 000		1 000 000				
NETWORK RAIL INFRASTRUCTURE FINANCE PLC 4.375000% 05-09.12.30*	GBP	1 000 000		1 000 000				
SNCF RESEAU-REG-S 5.250000% 99-07.12.28*	GBP		4 000 000		4 000 000	6 391 698	0,76	600 000
SNCF RESEAU-REG-S 5.250000% 01-31.01.35*	GBP		1 000 000		1 000 000	1 803 438	0,22	
TEMASEK FINANCIAL LTD 5.125000% 10-26.07.40*	GBP	1 000 000			1 000 000	2 003 518	0,24	
TRANSPORT FOR LONDON 4.000000% 13-12.09.33*	GBP	500 000		500 000				
TRANSPORT FOR LONDON-REG-S 2.125000% 15-24.04.25*	GBP		2 000 000		2 000 000	2 536 576	0,30	
Total GBP						26 852 587	3,20	
USD								
AFRICA FINANCE CORP-REG-S 4.375000% 19-17.04.26*	USD	3 000 000			3 000 000	2 964 237	0,35	2 930 000
AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE-REG-S 3.994000% 19-21.09.29*	USD	2 600 000		2 600 000				
BNG BANK NV-REG-S 1.750000% 17-05.10.20*	USD	5 000 000		5 000 000				
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.750000% 17-02.11.27*	USD	4 000 000		4 000 000				
KOMMUNEKREDIT-REG-S 1.625000% 16-01.06.21*	USD	2 800 000		2 800 000				
LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK-REG-S 1.750000% 20-14.01.27*	USD		2 000 000	2 000 000				
MDGH - GMTN BV-REG-S 2.500000% 19-07.11.24*	USD		2 000 000	2 000 000				
Total USD						2 964 237	0,35	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						66 184 892	7,89	
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
EUR								
EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.000000% 19-10.01.24*	EUR	4 540 000		4 540 000				
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG-REG-S 0.000000% 20-06.04.23*	EUR		6 000 000	6 000 000				
Total EUR								0,00
JPY								
EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.000000% 13-18.01.33*	JPY	670 000 000		670 000 000				
Total JPY								0,00
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon								0,00
Medium-Term Notes, variabler Zins								
USD								
EUROPEAN BANK FOR RECON & DEV O/N SOFR+26BP 19-19.08.22*	USD		5 000 000		5 000 000	4 592 880	0,55	
LDKRBANK B-WUERT FOERDERBK 3M LIBOR+16BP 18-10.03.23*	USD	5 000 000	1 000 000		6 000 000	5 518 509	0,66	
NRW BANK-REG-S 3M LIBOR+4BP 19-08.02.21*	USD	7 000 000			7 000 000	6 431 572	0,77	
Total USD						16 542 960	1,97	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						16 542 960	1,97	

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Anleihen, fester Zins							
AUD							
AUSTRALIA-REG-S 1.00000% 20-21.12.30*	AUD	24 000 000		24 000 000	16 056 575	1,92	
AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 18-21.05.41*	AUD	4 500 000		4 500 000	3 619 687	0,43	
Total AUD					19 676 262	2,35	
CAD							
BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 8.75000% 92-19.08.22*	CAD	3 000 000		3 000 000	2 390 731	0,29	
CANADA HOUSING TRUST-144A 2.40000% 12-15.12.22*	CAD	700 000		700 000	503 306	0,06	
CANADA HOUSING TRUST-144A 1.95000% 15-15.12.25*	CAD	1 000 000		1 000 000	734 876	0,09	
Total CAD					3 628 913	0,43	
EUR							
AUSTRIA, REPUBLIC OF 2.40000% 13-23.05.34*	EUR	4 400 000	2 000 000	2 400 000	3 504 623	0,42	
AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.50000% 19-20.02.29*	EUR	4 000 000	4 000 000				
AUTOBAHNEN- & SCHNELLSTRASSEN AG-REG-S 0.10000% 20-16.07.35*	EUR	2 300 000	2 300 000				
BADEN-WUERTTEMBERG, STATE OF-REG-S 0.01000% 20-09.07.32*	EUR	3 500 000		3 500 000	3 849 492	0,46	500 000
BELGIUM, KINGDOM OF 4.25000% 10-28.03.41*	EUR	1 000 000	1 000 000	2 000 000	3 899 613	0,47	
BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 3.75000% 13-22.06.45*	EUR	300 000		300 000	588 181	0,07	
BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.80000% 15-22.06.25*	EUR	2 000 000	2 000 000				
BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.50000% 17-22.10.24*	EUR	2 500 000	2 500 000				
BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.25000% 17-22.06.57*	EUR	600 000		600 000	1 040 409	0,12	
BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.90000% 19-22.06.29*	EUR	2 000 000	500 000	2 500 000	2 995 418	0,36	
EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 3.00000% 13-04.09.34*	EUR	3 000 000	3 000 000				
EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 0.01000% 20-15.11.35*	EUR		2 800 000	2 800 000			
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA-REG-S 0.25000% 17-14.03.20*	EUR	1 760 000		1 760 000			
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.12500% 18-15.04.34*	EUR	4 000 000	3 000 000	1 000 000	1 271 071	0,15	
FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.50000% 19-15.09.29*	EUR	4 400 000	4 400 000				
FINNVERA OYJ-REG-S 0.37500% 19-09.04.29*	EUR	2 400 000	2 400 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.50000% 98-25.04.29*	EUR	500 000		500 000	815 171	0,10	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.75000% 12-25.10.27*	EUR	1 000 000	1 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45*	EUR	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 839 473	0,22	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 1.75000% 14-25.11.24*	EUR	4 500 000	4 500 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 0.50000% 15-25.05.25*	EUR	3 000 000	3 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.25000% 15-25.05.36*	EUR	2 000 000		2 000 000	2 571 532	0,31	
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.25000% 15-25.11.26*	EUR	11 000 000	11 000 000				
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.75000% 18-25.11.28*	EUR	4 000 000	8 000 000	12 000 000	14 156 541	1,69	
GERMANY, REPUBLIC OF 2.50000% 14-15.08.46*	EUR	5 000 000	5 000 000				
GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 03-04.07.34*	EUR	400 000	5 000 000	5 400 000			
GERMANY, REPUBLIC OF 3.25000% 10-04.07.42*	EUR	3 000 000	3 000 000				
ICELAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.62500% 20-03.06.26*	EUR		740 000	740 000	817 233	0,10	500 000
IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.10000% 19-15.05.29*	EUR	2 000 000		2 000 000	2 409 862	0,29	
ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 3.85000% 19-01.09.49*	EUR	1 500 000	1 500 000	1 500 000	2 392 364	0,29	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.50000% 14-01.03.30*	EUR	4 000 000	4 000 000	4 000 000	5 373 114	0,64	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.00000% 15-01.12.25*	EUR	2 000 000	2 000 000	2 000 000	2 342 854	0,28	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 2.25000% 16-01.09.36*	EUR	4 000 000	4 000 000				
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 1.25000% 16-01.12.26*	EUR	12 000 000		12 000 000	13 573 519	1,62	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.00000% 18-01.02.28*	EUR	7 000 000		7 000 000	8 302 583	0,99	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 0.05000% 18-15.04.21*	EUR	30 000 000	30 000 000				
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 3.00000% 19-01.08.29*	EUR	10 000 000	10 000 000				
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 1.75000% 19-01.07.24*	EUR	200 000	2 000 000	2 200 000			
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-REG-S 1.35000% 19-01.04.30*	EUR		10 000 000	10 000 000			
ITALY, REPUBLIC OF-BTP 0.35000% 19-01.02.25*	EUR	20 000 000	6 000 000	14 000 000	15 203 876	1,81	
ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 1.65000% 20-01.12.30*	EUR		4 250 000	4 250 000	4 926 365	0,59	
KOREA, REPUBLIC OF-REG-S 2.12500% 14-10.06.24*	EUR	1 000 000		1 000 000	1 166 255	0,14	
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.37500% 16-09.03.26*	EUR	7 000 000	7 000 000				
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.12500% 17-15.01.24*	EUR	6 000 000	6 000 000				
LATVIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.25000% 17-15.02.47*	EUR	700 000	700 000				
MADRID, COMUNIDAD DE-REG-S 2.87500% 14-17.07.23*	EUR	1 700 000		1 700 000	1 990 601	0,24	470 000
MALTA, REPUBLIC 2.30000% 15-24.07.29*	EUR	1 000 000		1 000 000	1 260 741	0,15	
MEXICO, UNITED STATES OF 1.87500% 16-23.02.22*	EUR	2 000 000		2 000 000	2 199 859	0,26	2 000 000
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 4.00000% 05-15.01.37*	EUR	1 000 000		1 000 000	1 832 838	0,22	
NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.50000% 12-15.01.33*	EUR	1 000 000	1 000 000				
NIEDERSACHSEN INVEST GMBH-REG-S 0.25000% 20-16.07.35*	EUR	11 100 000		11 100 000	12 266 984	1,46	
NIEDERSACHSEN, STATE OF-REG-S 0.75000% 18-15.02.28*	EUR	3 000 000	3 000 000				
NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 1.62500% 14-24.10.30*	EUR	2 000 000	2 000 000				
NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 0.50000% 16-16.04.26*	EUR	5 000 000	5 000 000				
NRW BANK-REG-S 0.50000% 17-13.09.27*	EUR	5 000 000	5 000 000				
ONTARIO, PROVINCE OF-REG-S 0.37500% 17-14.06.24*	EUR	5 000 000		5 000 000	5 520 186	0,66	2 000 000
PORTUGAL, REPUBLIC OF-OT-144A-REG-S 0.90000% 20-12.10.35*	EUR	5 000 000		5 000 000	5 602 083	0,67	1 000 000
PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 5.65000% 13-15.02.24*	EUR	3 000 000	3 000 000				
PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.20000% 15-17.10.22*	EUR	3 000 000	3 000 000				
PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.12500% 17-14.04.27*	EUR	1 000 000	1 000 000				
SACHSEN-ANHALT, STATE OF 1.87500% 14-10.04.24*	EUR	1 500 000	1 500 000				
SLOVAKIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.87500% 17-09.03.37*	EUR	1 000 000	1 000 000				
SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 15-25.03.35*	EUR	1 500 000	1 500 000				
SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 0.27500% 20-14.01.30*	EUR	600 000	600 000				
SPAIN, KINGDOM OF 0.40000% 17-30.04.22*	EUR	5 000 000	5 000 000				
SPAIN, KINGDOM OF 4.65000% 10-30.07.25*	EUR	1 000 000		1 000 000	1 334 821	0,16	
SPAIN, KINGDOM OF 4.20000% 05-31.01.37*	EUR	6 000 000		6 000 000	10 088 548	1,20	
SPAIN, KINGDOM OF 5.90000% 11-30.07.26*	EUR	1 500 000	1 500 000				
SPAIN, KINGDOM OF 6.00000% 98-31.01.29*	EUR	500 000	1 000 000	1 500 000	2 410 774	0,29	
SPAIN, KINGDOM OF-144A 5.15000% 13-31.10.28*	EUR	1 800 000		1 800 000	2 735 042	0,33	
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.15000% 15-31.10.25*	EUR	2 500 000	2 500 000				
SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 16-30.04.26*	EUR	1 000 000		1 000 000	1 207 713	0,14	
SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 1.60000% 15-30.04.25*	EUR	2 000 000	2 000 000				
SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 0.50000% 20-30.04.30*	EUR	500 000	500 000				
XUNTA DE GALICIA-REG-S 2.95000% 14-10.04.21*	EUR	1 000 000	1 000 000				
XUNTA DE GALICIA-REG-S 1.45000% 19-30.04.29*	EUR	500 000	500 000				
Total EUR					147 410 099	17,58	
GBP							
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 0.87500% 20-17.12.24*	GBP	2 500 000		2 500 000	3 038 064	0,36	500 000
INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 1.00000% 20-21.12.29*	GBP	6 000 000		6 000 000	7 438 663	0,89	2 900 000

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
QUEBEC, PROVINCE OF-REG-S 0.75000% 19-13.12.24*	GBP	4 000 000		4 000 000				
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 6.00000% 98-07.12.28*	GBP	2 000 000		2 000 000				
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 06-07.12.27*	GBP	10 000 000	1 000 000	11 000 000				
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.00000% 09-22.01.60*	GBP	1 800 000	1 200 000		3 000 000	7 583 551	0,90	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.25000% 12-22.01.44*	GBP	1 500 000			1 500 000	2 732 929	0,33	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.75000% 18-22.01.49*	GBP		3 500 000		3 500 000	5 203 718	0,62	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.50000% 14-22.01.45*	GBP	1 000 000			1 000 000	1 911 070	0,23	
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.75000% 16-07.09.37*	GBP	8 000 000		5 900 000	2 100 000	2 944 762	0,35	2 100 000
Total GBP						30 852 756	3,68	
JPY								
DEVELOPMENT BANK OF JAPAN 1.05000% 03-20.06.23*	JPY	785 000 000			785 000 000	7 008 588	0,84	
DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 2.30000% 06-19.03.26*	JPY	1 280 000 000	790 000 000	2 070 000 000				
JAPAN 0.10000% 16-20.06.26*	JPY	1 300 000 000		1 300 000 000				
JAPAN 0.10000% 17-20.12.27*	JPY	1 500 000 000		1 500 000 000				
JAPAN 0.10000% 18-20.09.28*	JPY	4 700 000 000	50 000 000	2 700 000 000	2 050 000 000	18 088 532	2,16	
JAPAN 0.10000% 19-20.06.29*	JPY		3 300 000 000		3 300 000 000	29 055 205	3,47	
JAPAN 0.10000% 20-20.12.29*	JPY		100 000 000		100 000 000	879 164	0,10	
JAPAN 0.10000% 20-20.03.30*	JPY		1 500 000 000		1 500 000 000	13 174 656	1,57	
JAPAN 0.20000% 16-20.06.36*	JPY	10 500 000 000	4 500 000 000	2 000 000 000	13 000 000 000	111 736 820	13,33	
JAPAN 0.30000% 16-20.06.46*	JPY	1 000 000 000	200 000 000	1 200 000 000				
Total JPY						179 942 964	21,46	
USD								
AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23*	USD	1 000 000		1 000 000				
ALBERTA, PROVINCE OF 1.30000% 20-22.07.30*	USD		7 000 000	7 000 000				
CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 3.00000% 10-26.10.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.00000% 17-19.07.20*	USD	1 500 000		1 500 000				
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.50000% 17-19.07.22*	USD	2 300 000	700 000		3 000 000	2 827 685	0,34	
COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.37500% 11-12.07.21*	USD	4 000 000			4 000 000	3 769 172	0,45	
HONG KONG SUKUK 2017 LTD-REG-S 3.13200% 17-28.02.27*	USD	1 000 000		1 000 000				
INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.37500% 20-28.07.25*	USD		5 000 000	5 000 000				
MANITOBA, PROVINCE OF 3.05000% 14-15.05.24*	USD	3 000 000			3 000 000	2 999 792	0,36	
NORDIC INVESTMENT BANK 2.50000% 18-28.04.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33*	USD	1 000 000		1 000 000				
Total USD						9 596 650	1,14	
Total Anleihen, fester Zins						391 107 643	46,65	
Anleihen, Nullcoupon								
EUR								
FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.00000% 19-25.11.29*	EUR		2 000 000		2 000 000	2 218 094	0,26	420 000
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.08.30*	EUR		16 400 000		16 400 000	18 642 248	2,22	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.02.30*	EUR		10 000 000	10 000 000				
NIEDERSACHSEN INVEST GMBH-REG-S 0.00000% 20-16.07.25*	EUR		8 600 000		8 600 000	9 445 801	1,13	
Total EUR						30 306 143	3,62	
Total Anleihen, Nullcoupon						30 306 143	3,62	
Anleihen, variabler Zins								
GBP								
NETWORK RAIL INFRAFIN PLC 1.750%/RPI LINKED 07-22.11.27*	GBP	750 000		750 000				
Total GBP								0,00
Total Anleihen, variabler Zins								0,00
Treasury-Notes, fester Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30*	USD		9 000 000		9 000 000	12 629 223	1,51	9 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 08-15.02.38*	USD		8 000 000	3 000 000	5 000 000	7 075 811	0,84	5 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39*	USD		4 800 000	4 800 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 4.62500% 10-15.02.40*	USD	3 000 000	1 000 000		4 000 000	5 925 938	0,71	2 975 000
AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 11-15.11.41*	USD	3 000 000			3 000 000	3 730 735	0,45	
AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 12-15.05.42*	USD	5 000 000			5 000 000	6 117 942	0,73	3 708 400
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 13-15.05.43*	USD	2 000 000	1 000 000	3 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 15-15.02.45*	USD	12 000 000			12 000 000			
AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 15-15.05.45*	USD	3 000 000			3 000 000			
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45*	USD	3 000 000			3 000 000			
AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.11.47*	USD	3 000 000		3 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 20-15.02.50*	USD		13 000 000		13 000 000	13 550 557	1,62	3 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 20-15.05.40*	USD		3 300 000		3 300 000	2 989 713	0,36	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.50000% 19-28.02.26*	USD	12 000 000	13 000 000	8 000 000	17 000 000	17 449 681	2,08	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27*	USD		13 000 000		13 000 000	13 466 111	1,61	5 961 229
AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-15.02.30*	USD		21 600 000		21 600 000	21 420 197	2,56	1 196 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.05.27*	USD		33 500 000		33 500 000	30 910 372	3,69	
AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25*	USD		25 000 000	25 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-15.06.23*	USD		25 000 000	10 000 000	15 000 000	13 817 856	1,65	14 718 500
AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-30.06.27*	USD		25 000 000		25 000 000	23 057 572	2,75	9 423 400
Total USD						172 141 708	20,53	
Total Treasury-Notes, fester Zins						172 141 708	20,53	
Treasury-Notes, variabler Zins								
USD								
AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 18-15.07.28*	USD	10 000 000			10 000 000	10 928 417	1,30	6 100 300
AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 20-15.01.30*	USD		20 000 000	20 000 000				
Total USD						10 928 417	1,30	
Total Treasury-Notes, variabler Zins						10 928 417	1,30	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						748 854 724	89,33	

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

CAD

BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 3.70000% 10-18.12.20*	CAD	700 000		700 000	485 015	0,06	
CDP FINANCIAL INC 4.60000% 10-15.07.20*	CAD	700 000	700 000				
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.95000% 19-30.09.29*	CAD	2 000 000		2 000 000	1 463 218	0,17	
MANITOBA, PROVINCE OF 2.45000% 15-02.06.25*	CAD	1 000 000		1 000 000	741 658	0,09	
Total CAD					2 689 891	0,32	

Total Notes, fester Zins

2 689 891 0,32

Anleihen, fester Zins

CAD

ALBERTA, PROVINCE OF 2.35000% 15-01.06.25*	CAD	3 000 000		3 000 000	2 210 365	0,26	
BRITISH COLUMBIA MUNICIPAL FINANCE AUTH 3.75000% 13-26.09.23*	CAD	1 000 000		1 000 000	751 631	0,09	
MONTREAL, CITY OF 3.50000% 13-01.09.23*	CAD	1 000 000		1 000 000	744 347	0,09	
MONTREAL, CITY OF 5.45000% 09-01.12.19*	CAD	2 000 000	2 000 000				
VANCOUVER, CITY OF 3.75000% 13-24.10.23*	CAD	700 000		700 000	527 216	0,06	
YORK, REGIONAL MUNICIPALITY OF 4.05000% 14-01.05.34*	CAD	1 500 000		1 500 000	1 318 852	0,16	
Total CAD					5 552 412	0,66	

Total Anleihen, fester Zins

5 552 412 0,66

Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

8 242 303 0,98

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Eurozone

SWISS LIFE FUNDS (F) MONEY MARKET EURO I**	EUR	2 020	640	2 660			
Total Eurozone							0,00

Total Investmentzertifikate, open end

0,00

Anleihen, fester Zins

CAD

NEWFOUNDLAND, PROVINCE OF 3.00000% 15-02.06.25**	CAD	3 000 000		3 000 000	2 271 834	0,27	
Total CAD					2 271 834	0,27	

Total Anleihen, fester Zins

2 271 834 0,27

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

2 271 834 0,27

Total Wertschriften

(davon ausgeliehen)					759 368 861	90,58	
---------------------	--	--	--	--	-------------	-------	--

Bankguthaben auf Sicht					72 256 659	8,62	
Derivative Finanzinstrumente					3 425 966	0,41	
Sonstige Vermögenswerte					3 286 152	0,39	
Gesamtfondsvermögen					838 337 638	100,00	

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-29 806 027		
Andere Verbindlichkeiten					-479 770		
Nettofondsvermögen					808 051 841		

Bewertungskategorie

Verkehrswert per
30.9.2020

in %
des Gesamt-
fondsvermögens³

Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	757 076 097	90,31
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	5 718 730	0,68
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	762 794 827	90,99

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.20*	-140	EUR	16 936 937	1 616	0,00
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20*	-80	USD	10 255 547	-6 891	0,00
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 14.12.20*	-15	JPY	19 864 171	-31 342	0,00
			47 056 655	-36 617	0,00

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUXL FUTURE 08.12.20*	7	EUR	1 679 365	15 687	0.00
			1 679 365	15 687	0.00

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 1 679 365

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
JPY	2 200 000 000	AUD	29 635 892	01.10.2020	362 330	0.04
CAD	23 500 000	CHF	16 177 753	16.10.2020	19 941	0.00
GBP	55 500 000	CHF	65 101 461	16.10.2020	-796 936	-0.10
JPY	25 130 000 000	CHF	219 691 441	16.10.2020	963 998	0.11
EUR	283 500 000	CHF	303 068 871	16.10.2020	-2 331 457	-0.28
USD	275 000 000	CHF	257 569 400	16.10.2020	5 016 478	0.60
CHF	11 830 564	EUR	11 000 000	16.10.2020	19 184	0.00
USD	3 000 000	EUR	2 598 079	16.10.2020	43 675	0.01
CHF	9 658 937	EUR	9 000 000	16.10.2020	36 312	0.00
CHF	6 982 754	EUR	6 500 000	16.10.2020	19 370	0.00
CHF	15 578 777	EUR	14 500 000	16.10.2020	41 346	0.00
CHF	10 227 244	EUR	9 500 000	16.10.2020	6 629	0.00
CHF	11 795 732	USD	13 000 000	16.10.2020	143 133	0.02
CHF	8 952 578	JPY	1 050 000 000	16.10.2020	186 451	0.02
EUR	4 193 826	JPY	530 000 000	16.10.2020	95 246	0.01
CHF	7 406 026	JPY	870 000 000	16.10.2020	166 312	0.02
CHF	594 670	GBP	500 000	16.10.2020	-990	0.00
USD	18 000 000	EUR	15 181 547	16.10.2020	-176 490	-0.02
CHF	479 098	GBP	400 000	16.10.2020	-4 155	0.00
JPY	10 500 000	CHF	89 987	16.10.2020	-1 403	0.00
JPY	6 000 000	CHF	52 691	16.10.2020	469	0.01
AUD	29 640 013	JPY	2 200 000 000	16.10.2020	-362 547	-0.03
					3 446 896	0.41

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 06.12.19	EUR	293	55
EURO-SCHATZ FUTURE 06.12.19	EUR	50	0
EURO-BUND FUTURE 06.03.20	EUR	321	321
EURO-SCHATZ FUTURE 06.03.20	EUR	50	50
EURO-BUND FUTURE 08.06.20	EUR	296	296
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.20	EUR	500	500
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.09.20	EUR	145	145
EURO-BUND FUTURE 08.09.20	EUR	245	245
EURO-SCHATZ FUTURE 08.09.20	EUR	800	800
EURO-BUND FUTURE 08.12.20	EUR	15	15
EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.20	EUR	0	140
EURO-BUXL FUTURE 08.12.20	EUR	15	15
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.19	JPY	75	75
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.20	JPY	52	52
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	200	200
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 15.06.20	JPY	58	58
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.20	USD	170	170
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.20	USD	36	36
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 14.09.20	JPY	50	50
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.09.20	USD	30	30
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20	USD	80	160
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 14.12.20	JPY	35	50

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUXL FUTURE 08.12.20	EUR	7	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.19	USD	0	360
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.19	USD	0	70
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.19	USD	0	400
US LONG BOND FUTURE 19.12.19	USD	0	110
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 16.12.19	AUD	0	100
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	USD	440	440
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.20	USD	70	70
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	USD	360	360
US LONG BOND FUTURE 20.03.20	USD	110	110
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 16.03.20	AUD	100	100
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	300	300
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.06.20	USD	700	700
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	360	360
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.06.20	USD	197	197
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.20	AUD	120	120
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.09.20	USD	83	83
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.09.20	AUD	120	120
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.09.20	USD	530	530
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.12.20	AUD	120	120
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20	USD	20	20

Jahresbericht per 30. September 2020

Swiss life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	900 000	JPY	96 728 232	25.10.2019
CHF	1 276 115	GBP	1 000 000	13.12.2019
CHF	84 479 045	USD	85 500 000	13.12.2019
CHF	12 740 741	GBP	10 000 000	13.12.2019
CHF	5 129 548	GBP	4 000 000	13.12.2019
CHF	2 199 485	EUR	2 000 000	16.01.2020
USD	1 000 000	CHF	981 631	16.01.2020
JPY	22 200 000 000	CHF	202 421 971	16.01.2020
JPY	1 600 000 000	CHF	14 570 026	16.01.2020
USD	4 500 000	CHF	4 427 024	16.01.2020
CHF	7 742 089	JPY	850 000 000	16.01.2020
CHF	10 849 817	USD	11 000 000	16.01.2020
USD	86 500 000	CHF	85 215 129	16.01.2020
USD	1 400 000	CHF	1 379 704	16.01.2020
CHF	987 868	USD	1 000 000	16.01.2020
EUR	7 000 000	CHF	7 690 788	16.01.2020
CHF	2 197 793	EUR	2 000 000	16.01.2020
CHF	990 347	USD	1 000 000	16.01.2020
CHF	910 149	JPY	100 000 000	16.01.2020
EUR	6 000 000	CHF	6 574 488	16.01.2020
CHF	909 402	JPY	100 000 000	16.01.2020
USD	7 000 000	CHF	6 913 984	16.01.2020
USD	3 000 000	CHF	2 948 403	16.01.2020
EUR	2 000 000	CHF	2 190 270	16.01.2020
JPY	700 000 000	CHF	6 358 072	16.01.2020
JPY	200 000 000	CHF	1 817 486	16.01.2020
USD	1 000 000	CHF	986 242	16.01.2020
GBP	46 300 000	CHF	59 883 911	16.01.2020
CHF	3 425 727	USD	3 500 000	16.01.2020
CHF	1 487 580	CAD	2 000 000	16.01.2020
CHF	1 283 931	GBP	1 000 000	16.01.2020
EUR	1 500 000	CHF	1 638 026	16.01.2020
EUR	1 000 000	CHF	1 091 029	16.01.2020
CHF	978 311	USD	1 000 000	16.01.2020
CHF	381 451	GBP	300 000	16.01.2020
CHF	868 972	EUR	800 000	16.01.2020
CHF	1 871 280	USD	2 000 000	12.03.2020
EUR	5 000 000	CHF	5 396 244	16.04.2020
USD	2 000 000	CHF	1 936 012	16.04.2020
EUR	374 500 000	CHF	404 294 471	16.04.2020
CAD	22 800 000	CHF	16 806 671	16.04.2020
JPY	23 650 000 000	CHF	208 408 979	16.04.2020
GBP	45 600 000	CHF	57 160 717	16.04.2020
USD	172 600 000	CHF	166 355 108	16.04.2020
GBP	3 000 000	CHF	3 763 346	16.04.2020
EUR	1 100 000	CHF	1 182 251	16.04.2020
USD	1 000 000	CHF	962 319	16.04.2020
EUR	2 000 000	CHF	2 146 224	16.04.2020
EUR	1 000 000	CHF	1 073 372	16.04.2020
USD	1 000 000	CHF	962 968	16.04.2020
EUR	2 500 000	CHF	2 690 442	16.04.2020
JPY	71 000 000	CHF	626 023	16.04.2020
GBP	2 500 000	CHF	3 161 484	16.04.2020
JPY	100 000 000	CHF	885 223	16.04.2020
GBP	1 000 000	CHF	1 260 181	16.04.2020
USD	4 000 000	CHF	3 869 296	16.04.2020
USD	3 000 000	CHF	2 897 660	16.04.2020
USD	12 000 000	CHF	11 623 176	16.04.2020
GBP	5 100 000	CHF	6 499 879	16.04.2020
USD	2 000 000	CHF	1 958 806	16.04.2020
GBP	1 000 000	CHF	1 259 411	16.04.2020
USD	3 800 000	CHF	3 688 759	16.04.2020
EUR	1 900 000	CHF	2 014 371	16.04.2020
GBP	400 000	CHF	488 462	16.04.2020
EUR	6 600 000	CHF	7 050 457	16.04.2020
USD	3 500 000	CHF	3 341 853	16.04.2020
JPY	260 000 000	CHF	2 304 242	16.04.2020
GBP	600 000	CHF	728 077	16.04.2020
GBP	1 800 000	CHF	2 187 643	16.04.2020
CAD	920 000	CHF	628 307	16.04.2020
USD	9 000 000	CHF	8 388 594	16.04.2020
USD	5 600 000	CHF	5 228 636	16.04.2020
USD	7 500 000	CHF	7 124 228	16.04.2020
CHF	12 649 555	EUR	12 000 000	16.04.2020
CHF	4 019 306	JPY	450 000 000	16.04.2020
CHF	268 444	CAD	400 000	16.04.2020
CHF	3 067 741	GBP	2 700 000	16.04.2020
CHF	9 300 833	USD	9 500 000	16.04.2020
GBP	2 800 000	CHF	3 225 659	16.04.2020
USD	10 600 000	CHF	10 384 381	16.04.2020
EUR	1 000 000	CHF	1 059 634	16.04.2020
EUR	11 900 000	CHF	12 575 061	16.04.2020
JPY	3 000 000 000	EUR	25 611 813	16.04.2020
CHF	26 360 210	EUR	25 000 000	16.04.2020
CHF	15 923 866	CAD	23 000 000	16.04.2020
CHF	361 971 433	EUR	343 000 000	16.04.2020
CHF	210 955 031	USD	217 000 000	16.04.2020
CHF	73 002 134	GBP	61 000 000	16.04.2020
CHF	240 487 110	JPY	27 000 000 000	16.04.2020
GBP	9 000 000	CHF	10 651 680	26.05.2020
EUR	26 399 597	USD	30 000 000	16.06.2020
USD	218 000 000	CHF	211 176 818	16.07.2020
CAD	23 000 000	CHF	15 885 939	16.07.2020
GBP	60 900 000	CHF	72 690 106	16.07.2020
EUR	338 500 000	CHF	356 968 492	16.07.2020

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
JPY	26 900 000 000	CHF	239 487 741	16.07.2020
JPY	801 514 328	CHF	7 200 000	16.07.2020
CAD	250 000	CHF	171 022	16.07.2020
USD	2 000 000	CHF	1 927 731	16.07.2020
GBP	1 000 000	CHF	1 203 247	16.07.2020
EUR	4 642 413	USD	5 000 000	16.07.2020
CHF	6 828 228	USD	7 000 000	16.07.2020
EUR	3 000 000	CHF	3 161 913	16.07.2020
GBP	600 000	CHF	718 510	16.07.2020
GBP	2 400 000	CHF	2 882 383	16.07.2020
CHF	10 299 408	EUR	9 800 000	16.07.2020
CHF	4 515 930	JPY	500 000 000	16.07.2020
CHF	26 312 743	EUR	25 000 000	16.07.2020
CHF	13 461 986	JPY	1 500 000 000	16.07.2020
CHF	11 229 660	GBP	9 500 000	16.07.2020
EUR	1 819 398	USD	2 000 000	16.07.2020
CHF	4 492 765	JPY	500 000 000	16.07.2020
CHF	4 349 769	USD	4 500 000	16.07.2020
CHF	2 860 953	USD	3 000 000	16.07.2020
EUR	1 500 000	CHF	1 627 929	16.07.2020
USD	30 000 000	EUR	26 604 330	16.07.2020
USD	30 000 000	EUR	26 381 141	16.07.2020
EUR	3 000 000	CHF	3 211 527	16.07.2020
EUR	3 200 000	CHF	3 414 109	16.07.2020
USD	2 500 000	CHF	2 360 083	16.07.2020
EUR	2 602 576	USD	3 000 000	28.07.2020
EUR	7 000 000	CHF	7 523 743	04.08.2020
USD	14 000 000	CHF	12 729 262	05.08.2020
JPY	2 200 000 000	AUD	29 635 892	01.10.2020
CAD	23 500 000	CHF	16 177 753	16.10.2020
GBP	55 500 000	CHF	65 101 461	16.10.2020
JPY	25 130 000 000	CHF	219 691 441	16.10.2020
EUR	283 500 000	CHF	303 068 871	16.10.2020
USD	275 000 000	CHF	257 569 400	16.10.2020
CHF	11 830 564	EUR	11 000 000	16.10.2020
USD	3 000 000	EUR	2 598 079	16.10.2020
CHF	9 658 937	EUR	9 000 000	16.10.2020
CHF	6 982 754	EUR	6 500 000	16.10.2020
CHF	15 578 777	EUR	14 500 000	16.10.2020
CHF	10 227 244	EUR	9 500 000	16.10.2020
CHF	11 795 732	USD	13 000 000	16.10.2020
CHF	8 952 578	JPY	1 050 000 000	16.10.2020
EUR	4 193 826	JPY	530 000 000	16.10.2020
CHF	7 406 026	JPY	870 000 000	16.10.2020
CHF	594 670	GBP	500 000	16.10.2020
USD	18 000 000	EUR	15 181 547	16.10.2020
CHF	479 098	GBP	400 000	16.10.2020
JPY	10 500 000	CHF	89 987	16.10.2020
JPY	6 000 000	CHF	52 691	16.10.2020
AUD	29 640 013	JPY	2 200 000 000	16.10.2020

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	148 253 477,13	18,35%
Total engagement- reduzierende Positionen	968 642 836,23	119,87%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,1425% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,4425% p.a.;
 - Klasse I-A3: 0,2425% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,25% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,50% p.a.;
 - Klasse I-A3: 0,25% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,15%
Klasse I-A2:	0,45%
Klasse I-A3:	0,25%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF	0.658514	JPY 1 = CHF	0.008706
CAD 1 = CHF	0.687816	MXN 1 = CHF	0.041618
EUR 1 = CHF	1.077372	USD 1 = CHF	0.918750
GBP 1 = CHF	1.187760		

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		1 549 394 772.80	1 075 058 769.34	861 027 996.79
Klasse I-A1	CH0114218610			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 031.52	1 006.88	962.12
Anzahl Anteile im Umlauf		1 368 367,6760	965 117,1470	828 591,0380
Klasse I-A2	CH0219870703			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 033.70	1 008.76	964.96
Anzahl Anteile im Umlauf		133 407,3080	102 404,3080	66 141,3080

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	5.3%	7.9%	-3.0%
Klasse I-A2	CHF	4.9%	7.5%	-3.3%
Referenzindex:				
Barclays Global Aggregate Corporates in CHF (CHF hedged)	CHF	3.9%	7.8%	-2.9%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Die Risikoprämien für Unternehmensanleihen wurden während der Berichtsperiode stark durch den Konjunkturunbruch aufgrund der Corona-Pandemie, als auch durch die nachfolgenden geldpolitischen Stützungsmaßnahmen der Notenbanken getrieben. Zu Beginn der Berichtsperiode führte die positive Marktstimmung zu einem Rückgang der Kreditprämien. Im März kam es dann wegen den Lockdown-Massnahmen zu einem starken Einbruch der globalen Konjunktur. Dies führte zu einer grösseren Korrektur an den Finanzmärkten und die Risikoprämien für Unternehmensanleihen weiteten sich stark aus. Die Notenbanken trafen in der Folge umfangreiche Lockerungsmassnahmen, wodurch die Finanzmärkte gestützt werden konnten. Besonders stark zur Erholung trugen dabei die Anleihen-Kaufprogramme des Fed und der EZB bei, wobei insbesondere die Käufe von Unternehmensanleihen zur positiven Stimmung an den Kreditmärkten beitrugen. Der Anlagefonds erzielte in der Berichtsperiode dank stark gesunkenen Marktzinsen und nur moderat höheren Risikoprämien einen klar positiven Ertrag. Das Ergebnis fiel auch aus relativer Sicht erfreulich aus. Durch die vorsichtige Kreditrisiko-Positionierung und eine gute Titelselektion konnte eine Outperformance im Vergleich zur Benchmark erzielt werden.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten	45,78
Grossbritannien	7,42
Frankreich	7,29
Deutschland	3,92
Japan	3,35
Schweiz	3,31
Schweden	3,07
Niederlande	3,02
Italien	2,02
Kanada	1,96
Übrige	12,21
Total	93,35

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	95 453 996.09	38 912 995.86
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 453 846 773.62	1 041 333 465.49
Derivative Finanzinstrumente	-248 695.62	-5 168 613.27
Sonstige Vermögenswerte	8 421 916.90	7 434 229.79
Gesamtfondsvermögen	1 557 473 990.99	1 082 512 077.87
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-7 318 821.09	-6 875 918.91
Andere Verbindlichkeiten	-760 397.10	-577 389.62
Nettofondsvermögen	1 549 394 772.80	1 075 058 769.34

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	99 904.82	97 758.09
Negativzinsen	-228 846.10	-65 863.63
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	27 258 137.85	25 108 380.01
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	1 487 725.85	3 333 718.61
Erträge der Effektenleihe	191 863.85	219 193.10
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	7 675 015.86	4 399 789.99
Total Ertrag	36 483 802.13	33 092 976.17
Aufwand		
Passivzinsen	-1 616.46	-62 190.61
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-1 612 116.42	-1 261 071.99
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-631 972.47	-390 091.58
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-93 919.63	-81 971.57
Sonstige Aufwendungen	-2 039.54	-2 145.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-1 718 307.27	-2 047 239.80
Total Aufwand	-4 059 971.79	-3 844 711.45
Nettoertrag	32 423 830.34	29 248 264.72
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	54 626 805.82	-17 281 355.29
Realisierter Erfolg	87 050 636.16	11 966 909.43
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-11 085 663.95	65 749 065.73
Gesamterfolg	75 964 972.21	77 715 975.16

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	32 423 830.34	29 248 264.72
Vortrag des Vorjahres	119 506.95	352 225.74
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	32 543 337.29	29 600 490.46
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-31 887 940.23	-29 480 983.51
Vortrag auf neue Rechnung	655 397.06	119 506.95

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 075 058 769.34	861 027 996.79
Ordentliche Jahresausschüttung	-30 812 114.32	-25 525 659.09
Saldo aus dem Anteilverkehr	429 183 145.57	161 840 456.48
Gesamterfolg	75 964 972.21	77 715 975.16
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 549 394 772.80	1 075 058 769.34

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	965 117,1470	828 591,0380
Ausgegebene Anteile	541 066,5290	319 438,1090
Zurückgenommene Anteile	-137 816,0000	-182 912,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	1 368 367,6760	965 117,1470
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	403 250,5290	136 526,1090
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	102 404,3080	66 141,3080
Ausgegebene Anteile	68 922,0000	65 086,0000
Zurückgenommene Anteile	-37 919,0000	-28 823,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	133 407,3080	102 404,3080
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	31 003,0000	36 263,0000

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	21.9760
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	21.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-7.5250
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	13.9750
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	21.5000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	18.5299
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	18.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-6.4750
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	12.0250
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	18.5000

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Notes, fester Zins							
EUR							
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.95000% 20-18.10.24*	EUR	2 300 000		2 300 000	2 654 387	0,17	800 000
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 3.70000% 20-02.04.40*	EUR	2 800 000	2 800 000				
AT&T INC 1.80000% 19-14.09.39*	EUR	3 400 000	3 400 000				
AT&T INC 2.05000% 20-19.05.32*	EUR	2 600 000	2 600 000				
AT&T INC 2.60000% 20-19.05.38*	EUR	2 900 000	2 900 000				
BAYER AG-REG-S 0.37500% 20-06.07.24*	EUR	6 000 000	6 000 000				
BAYER AG-REG-S 1.37500% 20-06.07.32*	EUR	5 300 000	5 300 000				
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 0.80000% 19-12.06.24*	EUR	2 100 000	100 000	2 200 000			
CHUBB INA HOLDINGS INC 1.40000% 19-15.06.31*	EUR	800 000		800 000	916 680	0,06	
CHUBB INA HOLDINGS INC 0.30000% 19-15.12.24*	EUR	2 800 000		2 800 000	3 026 657	0,19	800 000
CK HUTCHISON GROUP TELECOM FIN-REG-S 0.37500% 19-17.10.23*	EUR	6 100 000		6 100 000	6 624 678	0,43	
COCA-COLA CO/THE 0.12500% 20-15.03.29*	EUR	9 600 000		9 600 000	10 265 450	0,66	3 450 000
CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 2.00000% 20-17.07.30*	EUR	6 100 000	2 500 000	3 600 000	3 951 859	0,25	3 600 000
DANAHER CORP 2.50000% 20-30.03.30*	EUR	4 400 000		4 400 000	5 489 853	0,35	900 000
DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.00000% 20-15.01.32*	EUR	4 400 000		4 400 000	4 681 448	0,30	
EATON CAPITAL UNLIMITED CO-REG-S 0.69700% 19-14.05.25*	EUR	1 200 000	1 200 000				
ENGIE SA-REG-S 1.25000% 19-24.10.41*	EUR	4 700 000	4 700 000				
ESSITY AB-REG-S 0.50000% 20-03.02.30*	EUR	2 900 000		2 900 000	3 127 135	0,20	176 000
EUSTREAM AS-REG-S 1.62500% 20-25.06.27*	EUR	2 900 000		2 900 000	3 260 427	0,21	
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 0.75000% 19-21.05.23*	EUR	1 500 000		1 500 000	1 645 248	0,11	
GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV-REG-S 1.62500% 20-22.04.32*	EUR	2 500 000		2 500 000	2 979 785	0,19	100 000
HARLEY-DAVIDSON FIN SERV INC-REG-S 0.90000% 19-19.11.24*	EUR	1 300 000	1 300 000				
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 0.75000% 20-10.03.32*	EUR	1 400 000	1 400 000				
ICADE SANTE SAS-REG-S 0.87500% 19-04.11.29*	EUR	2 000 000		2 000 000	2 094 855	0,13	
ILLINOIS TOOL WORKS INC 0.25000% 19-05.12.24*	EUR	6 000 000		6 000 000	6 550 634	0,42	
JAB HOLDINGS BV-REG-S 1.00000% 19-20.12.27*	EUR	2 100 000		2 100 000	2 252 022	0,14	500 000
JT INTERNATIONAL FIN SERVICES BV-REG-S 1.00000% 19-26.11.29*	EUR	4 200 000	4 200 000				
KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES-REG-S 0.62500% 19-20.09.29*	EUR	3 500 000	1 200 000	2 300 000	2 504 054	0,16	1 526 000
LA MONDIALE SAM-REG-S-SUB 2.12500% 20-23.06.31*	EUR	3 300 000	3 300 000				
LANZA FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 1.62500% 20-21.04.27*	EUR	1 300 000		1 300 000	1 501 905	0,10	1 200 000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28*	EUR	5 800 000		5 800 000	6 249 609	0,40	700 000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.37500% 20-11.02.31*	EUR	4 600 000		4 600 000	4 967 285	0,32	2 600 000
LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.87500% 19-17.09.26*	EUR	6 300 000	2 000 000	4 300 000	4 616 903	0,30	3 370 000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC-REG-S 0.97800% 20-09.06.24*	EUR	2 800 000		2 800 000	3 102 393	0,20	
MOODY'S CORP 0.95000% 19-25.02.30*	EUR	2 600 000		2 600 000	2 937 781	0,19	
NESTLE FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 1.12500% 20-01.04.26*	EUR	5 000 000		5 000 000	5 735 946	0,37	5 000 000
PEPSICO INC 0.25000% 20-06.05.24*	EUR	4 800 000		4 800 000	5 235 108	0,34	4 800 000
PERNOD RICARD SA-REG-S 0.87500% 19-24.10.31*	EUR	1 200 000	1 200 000				
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 0.80000% 19-01.08.31*	EUR	3 200 000		3 200 000	3 396 270	0,22	
RECKITT BENCKISER TR SER NED BV-REG-S 0.37500% 20-19.05.26*	EUR	6 400 000		6 400 000	7 035 320	0,45	5 250 000
RELX FINANCE BV-REG-S 0.87500% 20-10.03.32*	EUR	1 300 000		1 300 000	1 421 170	0,09	
RICHEMONT INTERNATIONAL HOLDING SA-REG-S 1.12500% 20-26.05.32*	EUR	5 300 000	350 000	4 950 000	5 764 207	0,37	
RICHEMONT INTERNATIONAL HOLDING SA-REG-S 1.62500% 20-26.05.40*	EUR	6 700 000	1 500 000	5 200 000	6 174 334	0,40	1 600 000
STRYKER CORP 1.00000% 19-03.12.31*	EUR	4 200 000	2 200 000	2 000 000	2 186 092	0,14	
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S 0.75000% 20-24.07.32*	EUR	4 400 000		4 400 000	4 838 242	0,31	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.87500% 19-01.10.31*	EUR	2 800 000	2 800 000				
TRINITY ACQUISITION PLC-REG-S 2.12500% 16-26.05.22*	EUR	2 500 000		2 500 000	2 752 417	0,18	600 000
UNILEVER NV-REG-S 1.75000% 20-25.03.30*	EUR	1 400 000		1 400 000	1 723 972	0,11	
UNIQA INSURANCE GROUP AG-REG-S 1.37500% 20-09.07.30*	EUR	2 800 000		2 800 000	3 140 023	0,20	
UPJOHN FINANCE BV-REG-S 0.81600% 20-23.06.22*	EUR	2 400 000		2 400 000	2 613 043	0,17	2 000 000
UPJOHN FINANCE BV-REG-S 1.02300% 20-23.06.24*	EUR	3 300 000		3 300 000	3 627 217	0,23	1 500 000
UPJOHN FINANCE BV-REG-S 1.90800% 20-23.06.32*	EUR	4 400 000	2 400 000	2 000 000	2 241 473	0,14	
VF CORP 0.25000% 20-25.02.28*	EUR	1 400 000		1 400 000			
ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.00000% 19-23.02.26*	EUR	3 000 000		3 000 000			
ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 3.00000% 19-23.10.29*	EUR	2 600 000		2 600 000			
ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.50000% 19-23.10.27*	EUR	1 500 000	1 500 000				
Total EUR					143 285 881	9,20	
GBP							
BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 2.37500% 19-19.06.39*	GBP	2 400 000		2 400 000	3 198 925	0,21	172 000
MARKS & SPENCER FINANCE PLC-REG-S 3.25000% 19-10.07.27*	GBP	1 600 000	1 600 000				
WALES & WEST UTILITIES FIN PLC-REG-S 1.87500% 20-28.05.41*	GBP	3 600 000		3 600 000	4 333 735	0,28	
Total GBP					7 532 660	0,48	
JPY							
APPLE INC 0.35000% 15-10.06.20*	JPY	200 000 000	200 000 000				
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.30000% 16-02.11.26*	JPY	170 000 000		170 000 000	1 474 458	0,09	
Total JPY					1 474 458	0,09	
USD							
ABBOTT LABORATORIES 4.90000% 16-30.11.46*	USD	4 000 000	400 000	3 600 000	4 689 375	0,30	
ABBVIE INC 4.87500% 18-14.11.48*	USD	2 400 000		2 400 000	2 800 035	0,18	
ALPHABET INC 0.80000% 20-15.08.27*	USD	6 300 000		6 300 000	5 745 681	0,37	
ALTRIA GROUP INC 5.95000% 19-14.02.49*	USD	1 000 000		1 000 000	1 230 699	0,08	
AMAZON.COM INC 4.95000% 14-05.12.44*	USD	2 700 000		2 700 000	3 529 832	0,23	
AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.62500% 19-22.04.29*	USD	2 500 000		2 500 000			
AMGEN INC 2.45000% 20-21.02.30*	USD	5 700 000		5 700 000	5 550 751	0,36	
AMGEN INC 2.65000% 17-11.05.22*	USD	4 300 000	4 300 000				
ANALOG DEVICES INC 3.50000% 16-05.12.26*	USD	1 200 000		1 200 000	1 247 422	0,08	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 4.00000% 17-11.09.27*	USD	3 950 000	3 950 000				
ANHEUSER-BUSCH COS 4.90000% 19-01.02.46*	USD	2 450 000	2 450 000				
ANHEUSER-BUSCH WORLDWIDE INC 5.55000% 19-23.01.49*	USD	1 900 000		1 900 000			
ASTRAZENECA PLC 2.37500% 15-16.11.20*	USD	2 000 000	2 000 000				
ASTRAZENECA PLC 3.12500% 17-12.06.27*	USD	1 800 000		1 800 000	1 839 819	0,12	
AT&T INC 1.65000% 20-01.02.28*	USD	4 400 000		4 400 000	4 050 142	0,26	
AT&T INC 2.25000% 20-01.02.32*	USD	10 000 000		10 000 000	9 189 325	0,59	
AT&T INC 2.30000% 20-01.06.27*	USD	6 400 000		6 400 000	6 158 080	0,40	
AT&T INC 3.50000% 20-01.06.41*	USD	5 800 000	5 800 000				

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
AT&T INC 3.65000% 20-01.06.51*	USD	13 100 000	9 300 000	3 800 000	3 521 450	0,23	
AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30*	USD	7 261 000	5 000 000	2 261 000	2 462 279	0,16	
AT&T INC 5.15000% 18-15.02.50*	USD	2 800 000	2 800 000	5 600 000			
AT&T INC 5.45000% 17-01.03.47*	USD	3 450 000	3 450 000				
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 2.70400% 20-09.01.25*	USD	4 100 000		4 100 000	3 949 333	0,25	200 000
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 2.70000% 20-10.01.25*	USD	5 000 000		5 000 000	4 835 841	0,31	200 000
BANCO SANTANDER SA 2.74600% 20-28.05.25*	USD	3 000 000		3 000 000	2 891 177	0,19	
BANCO SANTANDER SA 3.50000% 17-11.04.22*	USD	2 600 000		2 600 000	2 477 794	0,16	
BANCO SANTANDER SA 3.49000% 20-28.05.30*	USD	2 000 000	2 000 000				
BANCO SANTANDER SA-SUB 5.17900% 15-19.11.25*	USD	1 200 000	200 000	1 400 000	1 456 479	0,09	
BARCLAYS PLC 3.20000% 16-10.08.21*	USD	2 100 000		2 100 000	1 973 857	0,13	
BAT CAPITAL CORP 3.55700% 18-15.08.27*	USD	3 750 000		3 750 000	3 720 974	0,24	
BAT CAPITAL CORP 4.54000% 18-15.08.47*	USD	3 800 000	1 700 000	2 100 000	2 066 118	0,13	
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 1.66800% 20-25.03.26*	USD	3 500 000		3 500 000	3 226 558	0,21	
BAXTER INTERNATIONAL INC 3.50000% 16-15.08.46*	USD	1 800 000		1 800 000	1 887 091	0,12	
BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.25000% 18-15.12.25*	USD	3 200 000	3 200 000				
BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.62500% 18-25.06.38*	USD	1 600 000	1 600 000				
BERKSHIRE HATHAWAY 4.25000% 19-15.01.49*	USD	3 000 000	1 648 000	1 352 000	1 616 332	0,10	
BIOGEN INC 2.25000% 20-01.05.30*	USD	1 800 000		1 800 000	1 693 569	0,11	
BIOGEN INC 3.15000% 20-01.05.50*	USD	1 900 000		1 900 000	1 722 626	0,11	
BLACKROCK INC 1.90000% 20-28.01.31*	USD	3 600 000		3 600 000	3 426 694	0,22	
BLACKROCK INC 3.25000% 19-30.04.29*	USD	3 000 000		3 000 000	3 186 612	0,20	
BLACKROCK INC/NEW YORK 3.50000% 14-18.03.24*	USD	1 950 000		1 950 000	1 974 319	0,13	
BOEING CO 5.70500% 20-01.05.40*	USD	6 000 000	6 000 000				
BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 1.74900% 20-10.08.30*	USD	3 300 000		3 300 000	3 008 586	0,19	
BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 2.77200% 20-10.11.50*	USD	8 600 000	7 500 000	1 100 000	932 601	0,06	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 3.25000% 17-27.02.27*	USD	3 700 000		3 700 000	3 889 206	0,25	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 4.25000% 20-26.10.49*	USD	1 500 000		1 500 000	1 809 817	0,12	
BROADCOM INC 4.15000% 20-15.11.30*	USD	5 000 000		5 000 000	5 160 360	0,33	
BROADCOM INC 4.30000% 20-15.11.32*	USD	2 000 000		2 000 000	2 099 143	0,13	
BUNGE LTD FINANCE CORP 1.63000% 20-17.08.25*	USD	3 700 000		3 700 000	3 414 244	0,22	
CAMPBELL SOUP CO 4.80000% 18-15.03.48*	USD	2 850 000		2 850 000	3 363 911	0,22	
CBS CORP 4.60000% 15-15.01.45*	USD	1 500 000		1 500 000	1 514 088	0,10	
CELGENE CORP 3.87500% 15-15.08.25*	USD	1 500 000	1 500 000				
CELGENE CORP 4.55000% 18-20.02.48*	USD	9 150 000	9 150 000				
CELGENE CORP 5.00000% 15-15.08.45*	USD	2 000 000	2 000 000				
CHARLES SCHWAB CORP 3.20000% 17-02.03.27*	USD	3 350 000		3 350 000	3 450 481	0,22	
CHEVRON CORP 1.55400% 20-11.05.25*	USD	10 000 000		10 000 000	9 520 560	0,61	
CHEVRON CORP 3.32600% 15-17.11.25*	USD	1 000 000		1 000 000	1 033 317	0,07	
CHEVRON USA INC 2.34300% 20-12.08.50*	USD	2 000 000		2 000 000	1 722 796	0,11	
CITIGROUP INC 2.35000% 16-02.08.21*	USD	1 200 000		1 200 000	1 121 090	0,07	
CK HUTCHISON INTNL 17 II LTD-REG-S 3.25000% 17-29.09.27*	USD	2 450 000		2 450 000	2 472 790	0,16	
CNPC GENERAL CAPITAL LTD-REG-S 3.95000% 12-19.04.22*	USD	1 300 000		1 300 000	1 245 509	0,08	200 000
COCA-COLA CO/THE 3.20000% 13-01.11.23*	USD	2 000 000		2 000 000	1 998 109	0,13	
COLORADO INTERSTATE GAS/ISSUING-144A 4.15000% 16-15.08.26*	USD	1 350 000		1 350 000	1 396 980	0,09	
COMCAST CORP 1.95000% 20-15.01.31*	USD	5 000 000		5 000 000	4 721 639	0,30	
COMCAST CORP 3.30000% 17-01.02.27*	USD	1 500 000		1 500 000	1 554 860	0,10	
COMCAST CORP 3.45000% 19-01.02.50*	USD	3 500 000		3 500 000	3 632 560	0,23	
CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 4.37500% 15-17.03.25*	USD	900 000		900 000	912 358	0,06	
CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 2.95000% 20-09.04.25*	USD	4 150 000	4 150 000				
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 3.57400% 17-09.01.23*	USD	2 200 000		2 200 000	2 090 757	0,13	2 050 000
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.80000% 16-15.09.22*	USD	300 000		300 000	291 652	0,02	
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.45000% 16-16.04.21*	USD	1 800 000		1 800 000	1 681 448	0,11	
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 4.55000% 16-17.04.26*	USD	1 900 000		1 900 000	2 035 484	0,13	
CSX CORP 3.25000% 17-01.06.27*	USD	3 050 000	3 050 000				
CUMMINS INC 0.75000% 20-01.09.25*	USD	2 100 000		2 100 000	1 935 245	0,12	
CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24*	USD	2 000 000		2 000 000	1 958 593	0,13	
DANONE-REG-S 2.94700% 16-02.11.26*	USD	1 050 000		1 050 000	1 069 801	0,07	
DANSKE BANK AS-144A 3.87500% 18-12.09.23*	USD	4 000 000	4 000 000				
DOMINION GAS HOLDINGS LLC 3.90000% 19-15.11.49*	USD	1 600 000		1 600 000	1 702 892	0,11	
DOW CHEMICAL CO 3.62500% 19-15.05.26*	USD	1 700 000		1 700 000	1 729 539	0,11	
EDISON INTERNATIONAL 3.55000% 19-15.11.24*	USD	1 600 000		1 600 000	1 549 839	0,10	
EDISON INTERNATIONAL 4.95000% 20-15.04.25*	USD	6 941 000		6 941 000	6 980 303	0,45	
ELECTRONIC ARTS INC 3.70000% 16-01.03.21*	USD	800 000	800 000				
ELI LILLY & CO 3.95000% 17-15.05.47*	USD	3 800 000	3 800 000				
EOG RESOURCES INC 2.62500% 12-15.03.23*	USD	1 500 000		1 500 000	1 436 132	0,09	
EQUINOR ASA 1.75000% 20-22.01.26*	USD	3 000 000		3 000 000	2 859 369	0,18	650 000
EXXON MOBIL CORP 4.11400% 16-01.03.46*	USD	1 200 000		1 200 000	1 310 051	0,08	
EXXON MOBIL CORP 4.32700% 20-19.03.50*	USD	3 800 000	3 800 000				
FEDEX CORP 4.55000% 16-01.04.46*	USD	1 400 000	1 400 000				
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 4.75000% 18-15.05.48*	USD	2 000 000	2 000 000				
FMC CORP 5.20000% 09-15.12.19*	USD	1 350 000		1 350 000			
FOMENTO ECONOMICO MEXIC SAB DE CV 3.50000% 20-16.01.50*	USD	6 300 000	6 300 000				
FORTIVE CORP 4.30000% 17-15.06.46*	USD	2 300 000		3 900 000	4 267 173	0,27	
FRESENIUS MEDICAL CARE US FINANCE-144A 5.75000% 11-15.02.21*	USD	4 100 000		4 100 000	3 835 147	0,25	
GILEAD SCIENCES INC 4.15000% 16-01.03.47*	USD	2 550 000		2 550 000	2 856 754	0,18	
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 0.53400% 20-01.10.23*	USD	4 000 000		4 000 000	3 680 654	0,24	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.37500% 10-15.03.20*	USD	1 400 000	1 400 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 6.45000% 06-01.05.36*	USD	1 000 000	1 000 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26*	USD	750 000	750 000				
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.20*	USD	1 700 000	1 700 000				
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.75000% 20-01.04.26*	USD	16 000 000	4 400 000	11 600 000	10 735 945	0,69	400 000
HOME DEPOT INC/THE 2.80000% 17-14.09.27*	USD	6 200 000		6 200 000	6 290 204	0,40	
HOME DEPOT INC/THE 3.35000% 15-15.09.25*	USD	1 300 000		1 300 000	1 345 972	0,09	
HOME DEPOT INC/THE 3.90000% 17-15.06.47*	USD	1 600 000		1 600 000	1 814 928	0,12	
HORMEL FOODS CORP 1.80000% 20-11.06.30*	USD	2 900 000		2 900 000	2 750 122	0,18	
HSBC HOLDINGS PLC 4.95000% 20-31.03.30*	USD	1 900 000	1 900 000				
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.85000% 19-01.11.22*	USD	3 200 000		3 200 000	3 040 313	0,20	
ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65000% 16-15.11.26*	USD	1 500 000	1 500 000				
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 3.50000% 19-26.07.26*	USD	1 900 000		1 900 000	1 888 491	0,12	
ING BANK NV-REG-S-SUB 5.80000% 13-25.09.23*	USD	1 900 000	1 900 000				
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 3.00000% 20-15.06.50*	USD	2 800 000		2 800 000	2 668 300	0,17	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.25000% 19-15.05.49*	USD	3 400 000		3 400 000	3 916 254	0,25	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.95000% 20-15.05.30*	USD	2 900 000		2 900 000	2 748 769	0,18	
INTUIT INC 0.95000% 20-15.07.25*	USD	2 200 000	2 200 000				
INTUIT INC 1.65000% 20-15.07.30*	USD	3 200 000		3 200 000	2 986 872	0,19	
JOHNSON & JOHNSON 0.95000% 20-01.09.27*	USD	9 500 000		9 500 000	8 768 122	0,56	
JOHNSON & JOHNSON 2.10000% 20-01.09.40*	USD	14 300 000		14 300 000	13 117 047	0,84	

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 20-01.09.60*	USD		14 700 000		14 700 000	13 669 994	0,88
JOHNSON & JOHNSON 3.70000% 16-01.03.46*	USD	1 000 000			1 000 000	1 150 014	0,07
JPMORGAN CHASE & CO 3.12500% 15-23.01.25*	USD	1 250 000			1 250 000	1 252 780	0,08
JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.87500% 14-10.09.24*	USD	1 600 000			1 600 000	1 630 504	0,10
JUNIPER NETWORKS INC 5.95000% 11-15.03.41*	USD	1 900 000			1 900 000	2 212 291	0,14
KEURIG DR PEPPER INC 3.40000% 15-15.11.25*	USD	2 250 000			2 250 000	2 302 362	0,15
KEURIG DR PEPPER INC 4.50000% 15-15.11.45*	USD	1 600 000			1 600 000	1 804 746	0,12
KIMBERLY-CLARK CORP 2.75000% 16-15.02.26*	USD	3 350 000			3 350 000	3 385 191	0,22
KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 14-01.03.21*	USD	1 400 000			1 400 000	1 295 444	0,08
KINDER MORGAN INC 2.00000% 20-15.02.31*	USD		6 600 000		6 600 000	5 841 891	0,38
KINDER MORGAN INC 3.15000% 17-15.01.23*	USD	8 650 000			8 650 000	8 346 801	0,54
KINDER MORGAN INC 5.20000% 18-01.03.48*	USD	1 100 000	100 000	1 200 000			
LOWE'S COS INC 4.05000% 17-03.05.47*	USD	3 350 000			3 350 000	3 680 503	0,24
MAGNA INTERNATIONAL INC 2.45000% 20-15.06.30*	USD		3 000 000		3 000 000	2 903 314	0,19
MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29*	USD	1 700 000			1 700 000	1 891 088	0,12
MASTERCARD INC 3.35000% 20-26.03.30*	USD		900 000	900 000			
MASTERCARD INC 3.85000% 20-26.03.50*	USD	1 600 000			1 600 000	1 876 781	0,12
MEDTRONIC INC 4.62500% 15-15.03.45*	USD	369 000			369 000	466 698	0,03
METLIFE INC 4.60000% 15-13.05.46*	USD	1 300 000			1 300 000	1 565 522	0,10
MICROSOFT CORP 2.52500% 20-01.06.50*	USD		2 250 000		2 250 000	2 161 904	0,14
MICROSOFT CORP 3.70000% 16-08.08.46*	USD	1 950 000			1 950 000	2 249 663	0,14
MICROSOFT CORP 4.45000% 15-03.11.45*	USD	2 250 000		2 250 000			
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.66300% 17-28.02.27*	USD	3 950 000			3 950 000	4 055 260	0,26
MOODY'S CORP 2.75000% 17-15.12.21*	USD	2 150 000			2 150 000		
MPLX LP 2.65000% 20-15.08.30*	USD		6 100 000		6 100 000	5 470 227	0,35
MPLX LP 5.50000% 18-15.02.49*	USD	2 100 000		2 200 000			
MYLAN INC 5.20000% 19-15.04.48*	USD		2 500 000		2 500 000	2 840 026	0,18
NASDAQ INC 3.25000% 20-28.04.50*	USD	1 300 000			1 300 000	1 247 403	0,08
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26*	USD	2 100 000	2 100 000	4 200 000			
NEXTERA ENERGY 3.50000% 19-01.04.29*	USD	1 600 000			1 600 000	1 672 339	0,11
NIKE INC 3.37500% 16-01.11.46*	USD	1 350 000			1 350 000	1 403 170	0,09
NIKE INC 3.87500% 15-01.11.45*	USD	2 100 000			2 100 000	2 402 972	0,15
NOMURA HOLDINGS INC 3.10300% 20-16.01.30*	USD		5 300 000	3 000 000	2 300 000	2 243 695	0,14
NORFOLK SOUTHERN CORP 4.80000% 13-15.08.43*	USD	561 000			561 000	637 750	0,04
NORFOLK SOUTHERN CORP 3.94200% 18-01.11.47*	USD	1 279 000			1 279 000	1 410 110	0,09
NUTRIEN LTD 3.15000% 18-01.10.22*	USD	2 100 000			2 100 000	2 015 501	0,13
NVIDIA CORP 3.50000% 20-01.04.40*	USD		2 100 000		2 100 000	2 261 111	0,15
NVIDIA CORP 3.50000% 20-01.04.50*	USD		4 100 000	2 050 000	2 050 000	2 204 148	0,14
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.20000% 19-15.08.26*	USD	2 700 000	100 000	2 800 000			
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.30000% 19-15.08.39*	USD	1 600 000	100 000	1 700 000			
ONEOK INC 2.75000% 19-01.09.24*	USD	2 800 000	100 000		2 900 000	2 728 806	0,18
ORACLE CORP 3.25000% 15-15.05.30*	USD	1 900 000			1 900 000		
ORACLE CORP 3.60000% 20-01.04.40*	USD		4 000 000	4 000 000			
PACKAGING CORP OF AMERICA 3.40000% 17-15.12.27*	USD	1 505 000			1 505 000	1 544 462	0,10
PARKER-HANNIFIN CORP 3.25000% 19-14.06.29*	USD	1 600 000			1 600 000	1 646 322	0,11
PEPSICO INC 0.75000% 20-01.05.23*	USD		2 500 000		2 500 000	2 320 227	0,15
PEPSICO INC 3.45000% 16-06.10.46*	USD	2 500 000			2 500 000	2 662 505	0,17
PEPSICO INC 4.00000% 17-02.05.47*	USD	2 250 000			2 250 000	2 610 208	0,17
PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.62500% 17-19.06.47*	USD		1 400 000		1 400 000	1 479 188	0,09
PFIZER INC 2.75000% 16-03.06.26*	USD	1 200 000		1 200 000			400 000
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.50000% 20-01.05.25*	USD	5 200 000			5 200 000	4 930 619	0,32
PHILLIPS 66 3.85000% 20-09.04.25*	USD	1 200 000			1 200 000	1 224 613	0,08
PHILLIPS 66 4.87500% 14-15.11.44*	USD	3 100 000			3 100 000	3 385 576	0,22
PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.15000% 19-15.12.29*	USD	1 100 000		1 100 000			
PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.95000% 15-23.02.25*	USD	2 350 000			2 350 000	2 358 388	0,15
PRAXAIR INC 3.55000% 12-07.11.42*	USD	900 000			900 000	987 010	0,06
PROCTER & GAMBLE CO 2.70000% 16-02.02.26*	USD	1 600 000			1 600 000	1 639 239	0,11
PROCTER & GAMBLE CO 2.45000% 16-03.11.26*	USD	1 300 000		1 300 000			
PROCTER & GAMBLE CO 3.50000% 17-25.10.47*	USD	3 500 000			3 500 000	4 022 711	0,26
PROCTER & GAMBLE CO 3.60000% 20-25.03.50*	USD		1 100 000		1 100 000	1 281 462	0,08
RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 4.37500% 15-04.08.25*	USD	2 100 000			2 100 000	2 186 732	0,14
RALPH LAUREN CORP 3.75000% 18-15.09.25*	USD	7 000 000		340 000	6 660 000	6 865 142	0,44
RELX CAPITAL INC 3.00000% 20-22.05.30*	USD		1 600 000		1 600 000	1 607 347	0,10
ROPER TECHNOLOGIES INC 1.00000% 20-15.09.25*	USD		4 700 000		4 700 000		
S&P GLOBAL INC 2.95000% 17-22.01.27*	USD	1 000 000			1 000 000	1 027 845	0,07
S&P GLOBAL INC 4.40000% 15-15.02.26*	USD	1 100 000			1 100 000		
SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 3.62500% 20-28.01.26*	USD		6 500 000	6 500 000			
SCENTRE GROUP TRUST-REG-S 4.37500% 20-28.05.30*	USD		5 700 000	5 700 000			
SERVICE PROPERTIES TRUST 4.35000% 19-01.10.24*	USD	5 900 000			5 900 000		
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.40000% 13-12.08.23*	USD	1 200 000			1 200 000		
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26*	USD	1 200 000			1 200 000	1 220 614	0,08
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.75000% 16-12.09.21*	USD		500 000		500 000	465 815	0,03
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.75000% 16-12.09.46*	USD	2 000 000			2 000 000	2 050 143	0,13
SHERWIN-WILLIAMS CO 2.75000% 17-01.06.22*	USD	1 215 000		1 215 000			
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 3.12500% 17-16.03.24*	USD	3 300 000			3 300 000	3 273 920	0,21
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.37500% 17-15.06.27*	USD	6 550 000		6 550 000			
SINOPEC GROUP OVERSEA DEVELOPMENT-REG-S 2.00000% 16-29.09.21*	USD	3 250 000			3 250 000	3 018 596	0,19
SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 4.75000% 15-24.11.25*	USD	1 300 000			1 300 000	1 310 426	0,08
SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 4.25000% 15-14.04.25*	USD	1 100 000			1 100 000	1 077 995	0,07
SWISS RE AMERICA HOLDING CORP 7.00000% 96-15.02.26*	USD	500 000			500 000	590 960	0,04
SYSCO CORP 2.50000% 16-15.07.21*	USD	1 300 000		1 300 000			
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.05000% 20-31.03.30*	USD		4 600 000		4 600 000	4 278 951	0,27
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.02500% 20-09.07.40*	USD		6 700 000	2 600 000	4 100 000	3 903 123	0,25
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.17500% 20-09.07.50*	USD		6 400 000	4 900 000	1 500 000	1 410 759	0,09
TARGET CORP 3.62500% 16-15.04.46*	USD	2 050 000			2 050 000	2 376 650	0,15
TELEFONICA EMISIONES SA 4.57000% 13-27.04.23*	USD	1 000 000			1 000 000	1 006 736	0,06
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.15000% 18-15.05.48*	USD	4 000 000		2 000 000	2 000 000	2 402 937	0,15
TEXAS INSTRUMENTS INC 1.75000% 20-04.05.30*	USD		2 800 000		2 800 000	2 653 476	0,17
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 4.13300% 20-25.03.25*	USD		1 800 000	1 800 000			
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.12700% 20-29.05.50*	USD		12 000 000	6 000 000	6 000 000	5 721 209	0,37
TYSON FOODS INC 2.25000% 17-23.08.21*	USD	1 900 000			1 900 000		
UBS GROUP AG-REG-S 3.49100% 17-23.05.23*	USD	8 950 000			8 950 000	8 575 842	0,55
UNILEVER CAPITAL CORP 2.60000% 17-05.05.24*	USD	2 500 000			2 500 000	2 459 218	0,16
UNION PACIFIC CORP 2.15000% 20-05.02.27*	USD		1 800 000	1 800 000			
UNITED PARCEL SERVICE INC 3.40000% 16-15.11.46*	USD	1 300 000			1 300 000	1 342 563	0,09
UNITEDHEALTH GROUP INC 1.25000% 20-15.01.26*	USD		5 000 000		5 000 000	4 716 133	0,30
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.90000% 20-15.05.50*	USD		2 400 000		2 400 000	2 325 410	0,15
VALERO ENERGY CORP 3.40000% 16-15.09.26*	USD	2 500 000		1 500 000	1 000 000	987 280	0,06

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.12500% 16-15.08.46*	USD	850 000			850 000	963 509	0,06	
VIACOMCBS INC 4.50000% 11-01.03.21*	USD	900 000		900 000				
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.45000% 16-01.06.26*	USD	3 500 000			3 500 000	3 513 583	0,23	
WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28*	USD	1 500 000		500 000	1 000 000	1 086 390	0,07	
WALT DISNEY CO 4.70000% 20-23.03.50*	USD		4 800 000	1 800 000	3 000 000	3 648 371	0,23	
WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-23.10.26*	USD	1 100 000		1 100 000				
WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27*	USD	3 050 000	100 000		3 150 000	3 175 811	0,20	1 500 000
ZOETIS INC 4.50000% 15-13.11.25*	USD	2 000 000		2 000 000				
ZOETIS INC 4.70000% 13-01.02.43*	USD	1 400 000			1 400 000	1 693 680	0,11	
Total USD						466 747 140	29,97	

Total Notes, fester Zins **619 040 138** **39,75**

Notes, Nullcoupon

EUR

BERKSHIRE HATHAWAY INC 0.00000% 20-12.03.25*	EUR		4 600 000		4 600 000	4 943 770	0,32	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 0.00000% 20-10.03.24*	EUR		3 035 000	3 035 000				
Total EUR						4 943 770	0,32	

Total Notes, Nullcoupon **4 943 770** **0,32**

Notes, variabler Zins

EUR

ENGIE SA-REG-S-SUB 1.625%/VAR 19-PRP*	EUR	5 100 000		5 100 000				
HELVETIA EUROPE SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 20-30.09.41*	EUR		3 800 000	3 800 000				
ING GROEP NV-REG-S-SUB 1.000%/VAR 19-13.11.30*	EUR		2 600 000		2 600 000	2 745 159	0,18	2 500 000
MERCK KGAA-REG-S-SUB 1.625%/VAR 20-09.09.80*	EUR		4 000 000	2 100 000	1 900 000	2 036 772	0,13	
OMV AG-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-PRP*	EUR		7 100 000	3 200 000	3 900 000	4 166 978	0,27	1 800 000
OMV AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP*	EUR		3 700 000		3 700 000	3 946 446	0,25	1 200 000
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-09.09.30*	EUR		3 700 000	3 700 000				
SWISS RE FIN UK PLC-REG-S-SUB 2.714%/VAR 20-04.06.52*	EUR		1 800 000	1 800 000				
TOTAL SE-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-PRP*	EUR		8 500 000	1 700 000	6 800 000	7 307 816	0,47	3 500 000
Total EUR						20 203 171	1,30	

USD

BANK OF AMERICA CORP 3.093%/VAR 17-01.10.25*	USD	5 900 000			5 900 000	5 845 060	0,38	
BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 2.588%/VAR 20-12.08.35*	USD		3 700 000	2 300 000	1 400 000	1 248 006	0,08	1 400 000
CITIBANK NA 3M LIBOR+57BP 18-23.07.21*	USD	4 000 000			4 000 000	3 688 959	0,24	
CITIGROUP INC 3.887%/VAR 17-10.01.28*	USD	3 150 000		3 150 000				
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.547%/VAR 20-18.09.31*	USD		10 100 000	4 000 000	6 100 000	5 662 876	0,36	
GENERAL MOTORS CO 3M LIBOR+80BP 17-07.08.20*	USD	2 650 000		2 650 000				
GOLDMAN SACHS GROUP 3M LIBOR+75BP 18-23.02.23*	USD	2 550 000			2 550 000	2 350 399	0,15	
HSBC HOLDINGS PLC 1.645%/VAR 20-18.04.26*	USD		5 400 000	2 950 000	2 450 000	2 242 316	0,14	
HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25*	USD		2 400 000	2 400 000				
HSBC HOLDINGS PLC 2.357%/VAR 20-18.08.31*	USD		6 800 000	3 000 000	3 800 000	3 437 290	0,22	1 000 000
HSBC HOLDINGS PLC 3.973%/VAR 19-22.05.30*	USD	600 000		600 000				
HSBC HOLDINGS PLC 3M LIBOR+150BP 16-05.01.22*	USD	1 900 000		1 900 000				
HSBC HOLDINGS PLC 3M LIBOR+100BP 18-18.05.24*	USD	4 250 000		4 250 000				
HSBC HOLDINGS PLC 3M LIBOR+138BP 18-12.09.26*	USD	6 000 000			6 000 000	5 461 582	0,35	
JPMORGAN CHASE & CO 3.220%/VAR 17-01.03.25*	USD	3 300 000			3 300 000	3 256 720	0,21	
JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29*	USD	6 800 000			6 800 000	7 027 263	0,45	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26*	USD	1 600 000		1 600 000		1 523 318	0,10	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 1.326%/VAR 20-15.06.23*	USD	2 800 000			2 800 000	2 587 724	0,17	
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3M LIBOR+65BP 18-26.07.21*	USD	3 600 000			3 600 000	3 320 283	0,21	
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3M LIBOR+84BP 19-16.07.23*	USD	2 900 000			2 900 000	2 671 516	0,17	
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3M LIBOR+63BP 20-25.05.24*	USD		8 200 000	3 000 000	5 200 000	4 759 919	0,31	600 000
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC VAR 20-10.07.24*	USD		10 200 000		10 200 000	9 447 719	0,61	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 3.960%/VAR 19-18.07.30*	USD	1 200 000			1 200 000	1 244 868	0,08	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3M LIBOR+145BP 19-15.08.22*	USD	3 800 000		3 800 000				
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 2.819%/VAR 20-30.01.26*	USD		7 000 000	4 250 000	2 750 000	2 603 336	0,17	2 400 000
UBS GROUP AG-REG-S 2.859%/VAR 17-15.08.23*	USD	2 250 000			2 250 000	2 143 876	0,14	
UBS GROUP AG-REG-S 3.126%/VAR 19-13.08.30*	USD	4 000 000			4 000 000	4 081 354	0,26	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 3M LIBOR+110BP 18-15.05.25*	USD	3 450 000			3 450 000	3 238 019	0,21	
Total USD						77 842 404	5,00	

Total Notes, variabler Zins **98 045 575** **6,30**

Medium-Term Notes, fester Zins

EUR

A2A SPA-REG-S 1.00000% 19-16.07.29*	EUR	1 200 000		1 200 000				
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-REG-S 1.50000% 19-27.06.24*	EUR	2 800 000	100 000	2 900 000				
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-REG-S 2.37500% 19-27.09.27*	EUR	1 300 000		1 300 000				
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-REG-S 3.00000% 19-27.03.31*	EUR	2 400 000						
AIR LIQUIDE FINANCE SA-REG-S 1.37500% 20-02.04.30*	EUR		700 000	700 000				
AIRBUS SE-REG-S 1.37500% 20-09.06.26*	EUR		4 500 000	4 500 000				
AIRBUS SE-REG-S 2.37500% 20-07.04.32*	EUR		2 400 000	2 400 000				
AIRBUS SE-REG-S 2.37500% 20-09.06.40*	EUR		3 500 000	3 500 000				
AKZO NOBEL NV-REG-S 1.62500% 20-14.04.30*	EUR		2 700 000		2 700 000	3 198 475	0,21	2 700 000
ALD SA-REG-S 0.37500% 19-18.07.23*	EUR	1 800 000			1 800 000	1 935 496	0,12	500 000
ALSTOM SA-REG-S 0.25000% 19-14.10.26*	EUR		3 000 000	3 000 000				
AMCO - ASSET MANAGEMENT CO SPA-REG-S 1.50000% 20-17.07.23*	EUR		4 300 000		4 300 000	4 751 628	0,31	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 1.65000% 19-28.03.31*	EUR	1 700 000		1 700 000				
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 2.87500% 20-02.04.32*	EUR		4 100 000	4 100 000				
ARCELORMITTAL-REG-S 2.25000% 19-17.01.24*	EUR	3 109 000		3 109 000				
ARCELORMITTAL-REG-S 1.00000% 19-19.05.23*	EUR		4 200 000	4 200 000				
AROUNDTOWN SA-REG-S 1.45000% 19-09.07.28*	EUR	2 800 000		2 000 000	800 000	874 101	0,06	800 000
ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 2.42900% 20-14.07.31*	EUR		2 600 000	2 600 000				
ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.75000% 16-12.05.24*	EUR	5 600 000		5 600 000				
ATLAS COPCO FINANCE DAC-REG-S 0.12500% 19-03.09.29*	EUR	1 600 000		1 600 000				
AUCHAN HOLDING SADIR-REG-S 2.37500% 19-25.04.25*	EUR	5 200 000		5 200 000				
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S-SUB 1.87500% 16-04.11.26*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 279 702	0,15	
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S-SUB 2.50000% 18-25.05.28*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 591 496	0,23	
BAT CAPITAL CORP-REG-S 1.12500% 17-16.11.23*	EUR		1 300 000	1 300 000		1 433 506	0,09	1 220 000
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.75000% 13-25.03.25*	EUR	5 000 000		5 000 000		5 939 068	0,38	
BAT NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 3.12500% 20-07.04.28*	EUR		4 400 000	3 200 000	1 200 000	1 479 459	0,09	1 200 000

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
BAXTER INTERNATIONAL INC 0.40000% 19-15.05.24*	EUR	2 700 000					
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 0.50000% 19-12.09.23*	EUR	6 100 000			6 100 000	6 532 484	0,42 300 000
BNP PARIBAS SA-REG-S 1.12500% 18-11.06.26*	EUR	7 350 000			2 900 000	4 969 864	0,32
BNP PARIBAS-REG-S 1.12500% 18-22.11.23*	EUR	4 200 000			4 200 000		
BPCE SA-REG-S 0.87500% 18-31.01.24*	EUR	4 000 000			4 000 000		
CAIXABANK SA-REG-S 0.62500% 19-01.10.24*	EUR	6 100 000			5 000 000	1 175 629	0,08
CEZ AS 5.00000% 09-19.10.21*	EUR	8 000 000			2 700 000	5 999 145	0,39
CEZ AS-REG-S 0.87500% 19-02.12.26*	EUR		3 100 000		3 100 000	3 403 979	0,22
CHORUS LTD-REG-S 1.12500% 16-18.10.23*	EUR	2 500 000			2 500 000	2 775 742	0,18
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 218 357	0,14 1 998 000
COLGATE-PALMOLIVE CO 0.87500% 19-12.11.39*	EUR		3 000 000		3 000 000		
COVESTRO AG-REG-S 0.87500% 20-03.02.26*	EUR		2 700 000		2 700 000	2 937 066	0,19
COVESTRO AG-REG-S 1.37500% 20-12.06.30*	EUR		2 600 000		2 600 000		
CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.62500% 19-23.04.27*	EUR		3 700 000		1 000 000	2 812 547	0,18
DAIMLER AG-REG-S 0.37500% 19-08.11.26*	EUR	2 200 000			2 200 000	2 336 941	0,15 2 100 000
DAIMLER AG-REG-S 1.12500% 19-06.11.31*	EUR		6 100 000	5 200 000	900 000	977 846	0,06 110 000
DANONE SA-REG-S 0.57100% 20-17.03.27*	EUR		1 600 000		1 600 000	1 783 838	0,11 800 000
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 0.25000% 19-06.09.24*	EUR	1 500 000			1 500 000		
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23*	EUR		5 900 000	2 400 000	3 500 000	3 789 053	0,24 1 900 000
ELECTRICIDADE DE PORTUGAL SA-REG-S 1.62500% 20-15.04.27*	EUR		1 700 000		1 700 000	1 979 770	0,13
ELENIA FINANCE OYJ-REG-S 2.87500% 13-17.12.20*	EUR	5 000 000			5 000 000		
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 0.37500% 19-17.06.27*	EUR		2 900 000		2 900 000	3 136 264	0,20 2 900 000
ENEXIS HOLDING NV-REG-S 0.75000% 19-02.07.31*	EUR	1 300 000			1 300 000	1 466 669	0,09 1 122 000
ENGIE SA-REG-S 2.12500% 20-30.03.32*	EUR		1 600 000		1 600 000	2 025 422	0,13 1 600 000
ENI SPA-REG-S 2.00000% 20-18.05.31*	EUR		4 700 000		4 700 000	5 737 013	0,37
ESSILORLUXOTTICA SA-REG-S 0.12500% 19-27.05.25*	EUR		3 200 000		3 200 000	3 472 970	0,22 2 600 000
EUROCLEAR BANK-REG-S 0.12500% 20-07.07.25*	EUR		3 400 000		3 400 000	3 684 678	0,24
EUROGRID GMBH-REG-S 1.11300% 20-15.05.32*	EUR		2 300 000		2 300 000	2 645 714	0,17
FASTIGHETS AB BALDER-REG-S 1.25000% 20-28.01.28*	EUR		2 900 000		2 900 000	3 017 163	0,19
FCA BANK SPAIN-REG-S 0.25000% 20-28.02.23*	EUR		3 100 000		3 100 000	3 322 633	0,21
FCA BANK SPAIN-REG-S 0.50000% 20-18.09.23*	EUR		4 700 000		4 700 000	5 058 049	0,32 2 400 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.25000% 16-01.05.25*	EUR	4 350 000			1 700 000	2 942 081	0,19 2 650 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE-REG-S 1.37500% 17-15.05.24*	EUR	6 550 000			5 050 000	1 661 470	0,11 268 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.12500% 19-19.08.24*	EUR	2 500 000			1 600 000	961 674	0,06 900 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.87500% 20-21.01.30*	EUR		4 900 000		4 900 000		
HEIDELBERGCEMENT FIN LUX SA-REG-S 1.12500% 19-01.12.27*	EUR	1 500 000			1 500 000		
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.37500% 20-03.03.27*	EUR		4 200 000		4 200 000	4 538 276	0,29
HEINEKEN NV-REG-S 2.25000% 20-30.03.30*	EUR		1 400 000	1 400 000			
HIT FINANCE BV-REG-S 0.62500% 17-27.03.23*	EUR		1 800 000		1 800 000	1 927 824	0,12 100 000
IBERDROLA FINANZAS SA-REG-S 0.87500% 20-16.06.25*	EUR		1 800 000		1 800 000	2 013 955	0,13 200 000
INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 1.00000% 19-04.07.24*	EUR	2 400 000			2 400 000	2 627 442	0,17
INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 0.75000% 19-04.12.24*	EUR		2 200 000		2 200 000		
ISLANDSBANKI HF-REG-S 1.12500% 19-12.04.22*	EUR	900 000			900 000		
JEFFERIES GROUP LLC-REG-S 1.00000% 19-19.07.24*	EUR	3 500 000			3 500 000		
KERING SA-REG-S 0.25000% 20-13.05.23*	EUR		3 100 000		3 100 000	3 368 283	0,22 100 000
KERING SA-REG-S 0.75000% 20-13.05.28*	EUR		1 900 000		1 900 000	2 114 313	0,14 600 000
LA POSTE SA-REG-S 1.37500% 20-21.04.32*	EUR		1 800 000		1 800 000		
LA POSTE-REG-S 0.62500% 20-21.10.26*	EUR		1 900 000		1 900 000		
LANDSBANKINN HF-REG-S 0.50000% 20-20.05.24*	EUR		5 200 000		2 300 000	3 084 544	0,20
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 0.25000% 19-04.10.22*	EUR	3 000 000			3 000 000		
LUMINOR BANK AS/ESTONIA-REG-S 1.37500% 19-21.10.22*	EUR	3 300 000			2 292 000	5 592 000	6 063 428 0,39
MADRILENA RED DE GAS FINANCE BV-REG-S 2.25000% 17-11.04.29*	EUR	2 400 000			1 300 000	1 204 033	0,08
MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH-REG-S 0.87500% 19-05.07.31*	EUR	3 200 000			1 600 000	1 800 332	0,12 1 600 000
MORGAN STANLEY 1.87500% 17-27.04.27*	EUR	4 000 000			4 000 000		
NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC-REG-S 1.00000% 17-12.07.24*	EUR	1 300 000			1 300 000		
NATIONALENEDERLANDEN BANK-REG-S 0.37500% 19-31.05.23*	EUR	3 300 000			3 300 000	3 588 976	0,23 1 700 000
NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD-REG-S 1.50000% 20-01.04.30*	EUR		1 600 000		1 600 000	1 938 839	0,12 1 555 000
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27*	EUR		4 500 000		4 500 000	4 860 389	0,31
NIBC BANK NV-REG-S 0.87500% 19-08.07.25*	EUR	3 100 000			2 200 000	2 364 293	0,15 2 200 000
NORDEA BANK ABP-REG-S 0.87500% 18-26.06.23*	EUR	2 000 000			2 000 000		
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.87500% 19-17.01.24*	EUR	5 300 000			5 300 000	5 818 678	0,37 1 550 000
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.25000% 19-20.01.23*	EUR		3 200 000		3 200 000	3 453 424	0,22
OP CORPORATE BANK PLC 0.37500% 19-19.06.24*	EUR	2 450 000			2 450 000	2 652 865	0,17 1 340 000
ORANGE SA-REG-S 1.62500% 20-07.04.32*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 558 959	0,10 1 300 000
PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 1.62500% 20-17.06.32*	EUR		1 525 000		1 525 000	1 769 533	0,11
PROSEGUR CASH SA-REG-S 1.37500% 17-04.02.26*	EUR	5 600 000			5 600 000	6 201 673	0,40 4 500 000
PROSUS NV-REG-S 1.53900% 20-03.08.28*	EUR		1 300 000		1 300 000		
PROSUS NV-REG-S 2.03100% 20-03.08.32*	EUR		1 400 000		1 400 000		
REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 20-28.05.25*	EUR		3 200 000		3 200 000	3 601 540	0,23 2 200 000
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.25000% 19-02.08.27*	EUR	2 100 000			2 100 000		
RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRI-REG-S 1.12500% 20-08.07.40*	EUR		7 300 000		7 300 000		
SANOFI -REG-S 1.50000% 20-01.04.30*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 581 542	0,10
SANOFI-REG-S 1.00000% 20-01.04.25*	EUR		1 700 000	1 100 000	600 000	678 893	0,04 200 000
SANTANDER CONSUMER BANK AS-REG-S 0.12500% 19-11.09.24*	EUR	2 400 000			500 000	1 900 000	2 031 880 0,13
SCHAEFFLER AG-REG-S 1.87500% 19-26.03.24*	EUR	900 000			900 000		
SES SA-REG-S 0.87500% 19-04.11.27*	EUR		2 700 000		2 700 000		
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 1.12500 20-07.04.24*	EUR		6 000 000		6 000 000	6 738 627	0,43 3 190 000
SIEMENS FINANCIERINGSMMAATSCH NV-REG-S 0.50000% 19-05.09.34*	EUR	1 900 000			1 900 000		
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 0.79700% 20-05.08.26*	EUR		7 400 000		7 400 000	8 089 607	0,52 100 000
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 1.30300% 20-05.08.32*	EUR		8 500 000	2 800 000	5 700 000	6 202 432	0,40 2 000 000
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25*	EUR		2 000 000		1 500 000	563 840	0,04
SWEDBANK AB-REG-S 0.75000% 20-05.05.25*	EUR		4 500 000		4 500 000	4 993 174	0,32 4 500 000
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.87500% 19-01.10.49*	EUR	3 400 000			3 400 000		
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 0.37500% 19-25.04.24*	EUR	3 500 000			3 500 000	3 807 945	0,24 500 000
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.99400% 20-08.04.32*	EUR		3 000 000		3 000 000		
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD-REG-S 2.28000% 20-21.10.27*	EUR		1 300 000		1 300 000	1 593 988	0,10
UNIBAIL-RODAMCO-WESFLD SE-REG-S 0.87500% 19-29.03.32*	EUR		5 400 000		5 400 000		
UNILEVER NV-REG-S 1.25000% 20-25.03.25*	EUR		5 000 000		5 000 000	5 698 426	0,37 4 960 000
VATTENFALL AB-REG-S 0.50000% 19-24.06.26*	EUR	1 050 000			1 050 000		
VATTENFALL AB-REG-S 0.05000% 20-15.10.25*	EUR		2 400 000		2 400 000	2 586 934	0,17 200 000
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG-REG-S 1.50000% 19-01.10.24*	EUR	2 100 000			2 100 000		
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE-REG-S 1.25000% 20-23.09.32*	EUR		3 700 000		3 700 000	3 967 613	0,25
Total EUR						223 393 490	14,34
GBP							
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.25000% 20-26.06.28*	GBP		6 400 000		6 400 000	7 621 428	0,49
CITIGROUP INC 5.15000% 03-21.05.26*	GBP	4 400 000			3 200 000	1 728 792	0,11
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 2.00000% 18-04.09.23*	GBP	6 000 000			1 000 000	6 093 636	0,39 300 000
DANSKE BANK AS-REG-S 2.25000% 20-14.01.28*	GBP		4 000 000		4 000 000		

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
DEUTSCHE BANK AG-REG-S 2.62500% 20-16.12.24*	GBP		4 600 000	4 600 000				
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 1.75000% 19-11.07.24*	GBP	3 200 000			3 200 000	3 888 969	0,25	
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 1.50000% 20-23.06.23*	GBP		4 400 000		4 400 000	5 296 958	0,34	4 400 000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 1.12500% 20-11.02.27*	GBP		6 100 000		6 100 000	7 283 084	0,47	400 000
MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 2.37500% 19-03.07.39*	GBP	3 300 000			3 300 000	4 419 248	0,28	2 560 000
VODAFONE GROUP PLC-REG-S 3.00000% 16-12.08.56*	GBP	2 250 000			2 250 000	2 793 939	0,18	
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV-REG-S 2.75000% 19-10.07.23*	GBP	3 700 000			3 700 000	4 586 726	0,29	
Total GBP						43 712 782	2,81	

USD

AMERICAN EXPRESS CREDIT CORP 3.30000% 17-03.05.27*	USD	1 850 000			1 850 000	1 919 755	0,12	1 850 000
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.20000% 20-08.07.25*	USD		13 200 000		13 200 000	12 218 456	0,78	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.45000% 16-17.08.26*	USD	1 700 000			1 700 000	1 706 036	0,11	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.45000% 15-27.11.20*	USD	900 000		900 000				
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.85000% 18-28.04.28*	USD	2 800 000			2 800 000	3 106 859	0,20	
BNP PARIBAS SA-REG-S 2.95000% 17-23.05.22*	USD	1 900 000			1 900 000	1 808 743	0,12	
BPCE SA-REG-S-SUB 4.50000% 14-15.03.25*	USD	1 900 000			1 900 000	1 930 866	0,12	
COLGATE-PALMOLIVE CO 3.70000% 17-01.08.47*	USD	1 800 000			1 800 000	2 184 753	0,14	933 000
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 3.75000% 18-24.04.23*	USD	2 000 000			2 000 000	1 969 122	0,13	
ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 4.50000% 19-04.12.69*	USD		3 200 000	800 000	2 400 000	2 424 697	0,16	400 000
JT INTERNATIONAL FIN SERVICES BV-REG-S 3.87500% 18-28.09.28*	USD	6 000 000			6 000 000	6 382 207	0,41	
MORGAN STANLEY-SUB 3.95000% 15-23.04.27*	USD	1 000 000		1 000 000				
PSA INTERNATIONAL PTE LTD 3.87500% 10-11.02.21*	USD	1 300 000			1 300 000	1 207 310	0,08	
QNB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-07.09.21*	USD	1 300 000	200 000		1 500 000	1 389 753	0,09	
QNB FINANCE LTD-REG-S 2.75000% 20-12.02.27*	USD		7 100 000		7 100 000	6 800 358	0,44	2 660 000
ROYAL BANK OF CANADA 1.15000% 20-10.06.25*	USD		7 000 000		7 000 000	6 521 082	0,42	
SOCIETE GENERALE-REG-S 2.50000% 16-08.04.21*	USD	2 100 000			2 100 000	1 950 164	0,13	
SOCIETE GENERALE-REG-S 3.25000% 17-12.01.22*	USD	4 150 000			4 150 000	3 921 924	0,25	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.87500% 16-07.09.21*	USD	1 400 000			1 400 000	1 305 255	0,08	
TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50*	USD		4 600 000	4 000 000	600 000	562 309	0,04	600 000
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 1.80000% 20-13.02.25*	USD		9 300 000		9 300 000	8 926 913	0,57	5 000 000
UNION PACIFIC CORP 3.55000% 19-15.08.39*	USD	1 800 000			1 800 000	1 893 371	0,12	
WELLS FARGO & CO-SUB 4.90000% 15-17.11.45*	USD	2 500 000		2 500 000				
WELLS FARGO & CO-SUB 4.40000% 16-14.06.46*	USD	1 400 000		1 400 000				
Total USD						70 129 934	4,50	

Total Medium-Term Notes, fester Zins

337 236 206 21,65

Medium-Term Notes, Nullcoupon

EUR

VOLVO TREASURY AB-REG-S 0.00000% 20-11.02.23*	EUR		8 900 000		8 900 000	9 584 969	0,62	
VOLVO TREASURY AB-REG-S 0.00000% 20-11.02.23*	EUR		8 900 000	8 900 000				
Total EUR						9 584 969	0,62	

Total Medium-Term Notes, Nullcoupon

9 584 969 0,62

Medium-Term Notes, variabler Zins

EUR

AQUARIUS + INVESTMENTS PLC-SUB 4.250%/VAR 13-02.10.43*	EUR	1 100 000			1 100 000	1 301 179	0,08	250 000
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 1.000%/VAR 20-16.01.30*	EUR		2 100 000	2 100 000				
BANK OF AMERICA CO-REG-S 0.736%/3M EURIBOR+83BP 17-07.02.22*	EUR	2 850 000			2 850 000	3 080 029	0,20	1 000 000
BANK OF AMERICA CO-REG-S 1.379%/3M EURIBOR+103BP 17-07.02.25*	EUR	2 400 000		2 400 000				
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 1.381%/VAR 19-09.05.30*	EUR	3 900 000			3 900 000			
BANK OF AMERICA CORP-REG-S 0.580%/VAR 19-08.08.2029*	EUR	4 250 000		4 250 000				
CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 1.250%/VAR 20-11.06.29*	EUR		4 400 000		4 400 000	4 874 649	0,31	4 400 000
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 3.250%/VAR 20-02.04.26*	EUR		2 600 000		2 600 000	3 130 921	0,20	250 000
DNB BANK ASA-REG-S-SUB 1.250%/VAR 17-01.03.27*	EUR	3 400 000		3 400 000				
ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 1.000%/VAR 19-10.06.30*	EUR		3 100 000	3 100 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3M EURIBOR+55BP 20-21.04.23*	EUR		4 900 000	4 900 000				
ING BANK NV-SUB 3.625%/VAR 14-25.02.26*	EUR	1 950 000			1 950 000	2 127 347	0,14	
ING GROEP NV-REG-S 0.100%/VAR 19-03.09.25*	EUR	3 100 000			3 100 000	3 311 518	0,21	2 900 000
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 1.047%/VAR 19-04.11.32*	EUR		3 400 000	2 000 000	1 400 000	1 552 424	0,10	1 400 000
JPMORGAN CHASE & CO-REG-S 0.389%/3M EURIBOR+65BP 20-24.02.28*	EUR		6 900 000	4 300 000	2 600 000	2 769 423	0,18	2 600 000
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 0.500%/VAR 19-12.11.25*	EUR		2 100 000		2 100 000	2 251 332	0,14	
MORGAN STANLEY 0.637%/VAR 19-26.07.24*	EUR	5 400 000			5 400 000	5 886 600	0,38	5 400 000
ORANGE SA-REG-S-SUB 2.375%/VAR 19-PRP*	EUR	500 000	100 000	600 000				
RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 1.500%/VAR 19-12.03.30*	EUR	1 900 000		1 900 000				
RCI BANQUE SA-REG-S 3M EURIBOR+43BP 18-12.01.23*	EUR	3 000 000		3 000 000				
SANTANDER UK GROUP HOLD PLC-REG-S 0.391%/VAR 20-28.02.25*	EUR		6 000 000		6 000 000	6 386 598	0,41	2 000 000
SOCIETE GENERALE-REG-S-SUB 1.375%/VAR 18-23.02.28*	EUR	2 000 000		2 000 000				
TOTAL SE-REG-S-SUB 1.750%/VAR 19-PRP*	EUR	3 200 000		2 800 000	400 000	432 134	0,03	
TOTAL SE-REG-S-SUB 2.708%/VAR 16-PRP*	EUR	1 250 000			1 250 000	1 392 113	0,09	
Total EUR						38 496 268	2,47	

USD

AXA SA-REG-S-SUB 5.125%/VAR 17-17.01.47*	USD	4 750 000			4 750 000	4 958 666	0,32	
ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.700%/VAR 18-22.03.28*	USD	1 600 000			1 600 000	1 558 188	0,10	150 000
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 3.622%/VAR 19-26.04.23*	USD	3 100 000			3 100 000	2 959 243	0,19	
ROYAL BANK OF CANADA 3M LIBOR+388P 17-02.03.20*	USD	2 350 000		2 350 000				
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 3.516%/VAR 19-12.02.30*	USD		2 200 000	2 200 000				
Total USD						9 476 097	0,61	

Total Medium-Term Notes, variabler Zins

47 972 365 3,08

Anleihen, fester Zins

EUR

AEGON BANK NV-REG-S 0.62500% 19-21.06.24*	EUR	1 500 000		1 500 000				
BAYER CAPITAL CORP BV-REG-S 1.50000% 18-26.06.26*	EUR	2 500 000		2 500 000				
BEVCO LUX SARL-REG-S 1.50000% 20-16.09.27*	EUR		3 500 000		3 500 000	3 780 984	0,24	
BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO-REG-S 2.00000% 15-19.05.25*	EUR	2 550 000		2 550 000				
CETIN FINANCE BV-REG-S 1.42300% 16-06.12.21*	EUR	2 300 000			2 300 000	2 507 617	0,16	
CZECH GAS NETWORKS INVEST SARL-REG-S 1.00000% 20-16.07.27*	EUR		2 500 000		2 500 000	2 758 229	0,18	
DH EUROPE FINANCE II SARL 0.20000% 19-18.03.26*	EUR	3 700 000		3 700 000				
DH EUROPE FINANCE II SARL 0.45000% 19-18.03.28*	EUR	2 200 000		2 200 000				
EUTELSAT SA-REG-S 2.00000% 18-02.10.25*	EUR	1 900 000		1 900 000				
JAB HOLDINGS BV-REG-S 1.75000% 18-25.06.26*	EUR	2 500 000			2 500 000	2 839 528	0,18	1 400 000

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV-REG-S 1.75000% 20-02.04.27*	EUR		1 100 000	900 000	200 000	236 587	0,02	
LIBERTY MUTUAL GROUP INC-REG-S 2.75000% 16-04.05.26*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 404 242	0,15	
SIKA CAPITAL BV-REG-S 0.87500% 19-29.04.27*	EUR	800 000		800 000				
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-REG-S 3.00000% 18-21.11.30*	EUR	2 800 000			2 800 000	3 620 815	0,23	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.87500% 16-02.04.25*	EUR	4 550 000		2 150 000	2 400 000	2 675 148	0,17	
WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 0.45200% 19-25.09.23*	EUR	4 800 000		1 200 000	3 600 000	3 819 741	0,25	
WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 0.84000% 19-25.09.25*	EUR	4 700 000		1 200 000	3 500 000	3 660 318	0,24	900 000
WPC EUROBOND BV 2.12500% 18-15.04.27*	EUR	4 300 000			4 300 000	4 910 940	0,32	200 000
ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.75000% 15-27.04.23*	EUR	3 300 000		3 300 000				
Total EUR						33 214 149	2,13	
GBP								
APPLE INC 3.05000% 15-31.07.29*	GBP	700 000		700 000				
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 2.62500% 16-16.08.28*	GBP	1 000 000		1 000 000				
MCKESSON CORP 3.12500% 17-17.02.29*	GBP	7 000 000		300 000	6 700 000	8 725 063	0,56	
VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.50000% 19-08.04.31*	GBP	2 000 000			2 000 000	2 614 531	0,17	141 000
Total GBP						11 339 593	0,73	
USD								
ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.00000% 19-03.10.49*	USD	2 000 000	200 000		2 200 000	2 368 652	0,15	2 200 000
ACTIVISION BLIZZARD INC 2.30000% 17-15.09.21*	USD	1 500 000		1 500 000				
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 4.40000% 12-15.03.42*	USD	1 850 000			1 850 000	2 133 193	0,14	
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.05000% 18-15.06.48*	USD	2 850 000		2 850 000				
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.15000% 18-15.12.48*	USD	2 000 000			2 000 000	2 317 852	0,15	
CK HUTCHISON INTRNTNL 19 II LTD-REG-S 3.37500% 19-06.09.49*	USD	4 300 000		4 300 000				
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-REG-S 4.37500% 18-21.06.28*	USD	4 000 000			4 000 000	4 356 837	0,28	
DUKE ENERGY INDIANA LLC 3.25000% 19-01.10.49*	USD	2 400 000			2 400 000	2 461 113	0,16	
JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.25000% 15-01.10.27*	USD	700 000			700 000	749 162	0,05	
METLIFE INC-STEP UP 14-15.12.44*	USD	1 200 000			1 200 000	1 456 088	0,09	
NEXTERA ENERGY 2.75000% 20-01.05.25*	USD	7 000 000	7 000 000		7 000 000	6 951 190	0,45	
NOVARTIS CAPITAL CORP 4.40000% 14-06.05.44*	USD	1 300 000			1 300 000	1 606 548	0,10	
PACIFICORP 3.30000% 20-15.03.51*	USD	1 850 000	1 850 000		1 850 000	1 896 702	0,12	
SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.22200% 18-27.01.24*	USD	1 300 000			1 300 000	1 286 566	0,08	
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.50000% 15-01.09.25*	USD	5 600 000	2 200 000	2 200 000	3 400 000	3 424 161	0,22	
SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.87500% 19-01.03.49*	USD	3 850 000			3 850 000	4 298 491	0,28	
SPI AUSTRALIA ASSETS PTY LTD-REG-S STEP-UP/DOWN 12-09.04.23*	USD	1 500 000			1 500 000	1 445 198	0,09	
TOYOTA MOTOR 3.66900% 18-20.07.28*	USD	2 800 000			2 800 000	3 032 581	0,19	
UNION PACIFIC CORP 4.30000% 12-15.06.42*	USD	1 300 000		1 300 000				
VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.50000% 17-16.03.47*	USD	2 800 000		2 800 000				
VODAFONE GROUP PLC 4.12500% 18-30.05.25*	USD	1 100 000			1 100 000	1 152 404	0,07	
Total USD						40 936 739	2,63	
Total Anleihen, fester Zins						85 490 481	5,49	
Anleihen, variabler Zins								
EUR								
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP*	EUR		6 600 000	1 200 000	5 400 000	5 974 111	0,38	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP*	EUR		7 800 000	1 500 000	6 300 000	6 986 453	0,45	
MERCK KGAA-REG-S-SUB 1.625%/VAR 19-25.06.79*	EUR	1 300 000			1 300 000			
NGG FINANCE PLC-REG-S-SUB 1.625%/VAR 19-05.12.79*	EUR	2 100 000			2 100 000			
NGG FINANCE PLC-REG-S-SUB 2.125%/VAR 19-05.09.82*	EUR	2 900 000			2 900 000			
OMV AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP*	EUR	3 900 000			1 900 000	2 253 199	0,14	850 000
SWISS RE FINANCE LUX SA-REG-S-SUB 2.534%/VAR 19-30.04.50*	EUR	600 000		600 000				
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 13-PRP*	EUR	1 000 000			1 000 000	1 139 924	0,07	1 000 000
Total EUR						16 353 687	1,05	
GBP								
AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.375%/VAR-REG-S-SUB 13-06.09.73*	GBP		2 000 000	2 000 000				0,00
Total GBP								0,00
USD								
BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP*	USD		9 000 000	9 000 000				
BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.875%/VAR 20-PRP*	USD		7 200 000	7 200 000				
Total USD								0,00
Total Anleihen, variabler Zins						16 353 687	1,05	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 218 667 191	78,25	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

JPY

STARBUCKS CORP 0.37200% 17-15.03.24*	JPY	250 000 000			250 000 000	2 150 792	0,14	
Total JPY						2 150 792	0,14	

USD

ABBVIE INC-144A 2.95000% 19-21.11.26*	USD		6 200 000		6 200 000	6 204 511	0,40	
ABBVIE INC-144A 4.05000% 19-21.11.39*	USD		4 000 000		4 000 000	4 226 096	0,27	
ABBVIE INC-144A 4.25000% 19-21.11.49*	USD		3 200 000		3 200 000	3 490 300	0,22	
AIA GROUP LTD-144A 3.60000% 19-09.04.29*	USD	2 300 000		2 300 000				
AIA GROUP LTD-144A 3.37500% 20-07.04.30*	USD		1 600 000		1 600 000	1 649 096	0,11	
ALCON FINANCE CORP-144A 3.80000% 19-23.09.49*	USD	2 000 000			2 000 000	2 077 440	0,13	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 2.95000% 20-25.01.30*	USD	2 100 000			2 100 000	2 080 519	0,13	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 3.80000% 20-25.01.50*	USD	3 900 000	3 900 000					
ALTRIA GROUP INC 4.25000% 12-09.08.42*	USD	1 300 000			1 300 000	1 285 598	0,08	
AMERICAN TOWER CORP 3.12500% 16-15.01.27*	USD	2 600 000			2 600 000	2 608 407	0,17	
AT&T INC-144A 3.65000% 20-15.09.59*	USD		8 815 491	4 500 491	4 315 000	3 894 433	0,25	
BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO-144A 4.25000% 20-15.10.50*	USD		2 000 000		2 000 000	2 287 716	0,15	
BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO-144A 4.75000% 12-15.02.23*	USD	1 300 000		1 300 000				
BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO-144A 2.50000% 19-10.01.30*	USD	4 500 000			4 500 000	4 446 713	0,29	
BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 3.87500% 19-15.08.25*	USD		1 500 000	1 500 000				
BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 5.00000% 19-15.08.45*	USD		2 000 000	2 000 000				
BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 4.55000% 19-20.02.48*	USD		9 150 000	9 150 000				
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 4.55000% 20-20.02.48*	USD		6 150 000		6 150 000	7 641 437	0,49	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 4.25000% 19-26.10.49*	USD	1 500 000		1 500 000				
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.87500% 20-15.08.25*	USD		1 500 000		1 500 000	1 571 290	0,10	
BROADCOM INC 4.70000% 20-15.04.25*	USD		5 000 000		5 000 000	5 219 936	0,34	
BROADCOM INC-144A 4.70000% 20-15.04.25*	USD		5 000 000	5 000 000				
BROADCOM INC-144A 4.15000% 20-15.11.30*	USD		5 000 000	5 000 000				
BROADCOM INC-144A 4.30000% 20-15.11.32*	USD		4 000 000	4 000 000				
CBOE HOLDINGS INC 3.65000% 17-12.01.27*	USD	6 300 000			6 300 000	6 584 441	0,42	
CBS CORP 2.90000% 18-01.06.23*	USD	1 500 000		1 500 000				
CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 3.40000% 16-01.12.26*	USD	1 650 000	188 000		1 838 000	1 853 146	0,12	
CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 5.12500% 20-01.04.25*	USD		4 200 000	2 939 000	1 261 000	1 362 632	0,09	
COLBUN SA-REG-S 3.15000% 20-06.03.30*	USD		1 100 000		1 100 000	1 088 317	0,07	400 000
COSTCO WHOLESALE CORP 1.37500% 20-20.06.27*	USD		2 700 000	2 700 000				
COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.25000% 12-15.12.22*	USD	1 400 000			1 400 000	1 355 816	0,09	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 4.87500% 12-06.03.42*	USD	1 400 000			1 400 000	1 661 153	0,11	
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 3.60000% 17-19.01.27*	USD	3 250 000			3 250 000	3 345 827	0,21	
DOW CHEMICAL CO-144A 3.62500% 19-15.05.26*	USD	1 700 000		1 700 000				
EDP FINANCE BV-144A 1.71000% 20-24.01.28*	USD		11 000 000		11 000 000	10 068 149	0,65	
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 4.75000% 17-25.05.47*	USD	1 800 000			1 800 000	2 051 120	0,13	
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.85000% 13-15.03.44*	USD	1 300 000			1 300 000	1 358 447	0,09	
HUSKY ENERGY INC 4.40000% 19-15.04.29*	USD	2 100 000		2 100 000				
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 1.25000% 20-18.09.23*	USD		9 800 000		9 800 000	8 983 672	0,58	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.87500% 15-09.11.22*	USD	1 800 000		800 000	1 000 000	969 093	0,06	
KKR GROUP FINANCE CO VI LLC-144A 3.75000% 19-01.07.29*	USD	1 700 000			1 700 000	1 796 855	0,12	
KKR GROUP FINANCE CO VI LLC-REG-S 3.75000% 19-01.07.29*	USD	2 700 000			2 700 000	2 853 828	0,18	
KKR GROUP FINANCE CO VIII LLC-REG-S 3.50000% 20-25.08.50*	USD		4 300 000		4 300 000	4 025 832	0,26	
LEASEPLAN CORP NV-REG-S 2.87500% 19-24.10.24*	USD		3 400 000		3 400 000	3 223 763	0,21	
LYB INTERNATIONAL FINANCE BV 4.00000% 13-15.07.23*	USD	3 500 000			3 500 000	3 483 638	0,22	
MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 2.00000% 16-28.10.21*	USD	1 900 000			1 900 000	1 773 051	0,11	
MOODY'S CORP 3.25000% 18-15.01.28*	USD	1 800 000			1 800 000	1 860 736	0,12	
NESTLE HOLDINGS INC-144A 3.62500% 18-24.09.28*	USD	8 000 000			8 000 000	8 650 219	0,56	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.10000% 20-05.05.23*	USD		5 000 000		5 000 000	4 671 148	0,30	
NEWCREST FINANCE PTY LTD-144A 4.20000% 20-13.05.50*	USD	2 900 000			2 900 000	3 102 025	0,20	2 490 000
NUTRITION & BIOSCIENCES INC-144A 3.26800% 20-15.11.40*	USD	2 600 000			2 600 000	2 417 372	0,16	
ONEOK PARTNERS LP 3.37500% 12-01.10.22*	USD	2 000 000			2 000 000	1 908 950	0,12	
PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.30000% 15-01.06.20*	USD	2 100 000		2 100 000				
PROCTER & GAMBLE CO 2.45000% 20-25.03.25*	USD		900 000		900 000	895 513	0,06	
REGENERON PHARMACEUTICALS INC 1.75000% 20-15.09.30*	USD	4 300 000			4 300 000	3 866 793	0,25	
REGENERON PHARMACEUTICALS INC 2.80000% 20-15.09.50*	USD	3 100 000			3 100 000	2 684 263	0,17	
ROYALTY PHARMA PLC-144A 1.75000% 20-02.09.27*	USD	5 000 000			5 000 000	4 599 457	0,30	
SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 2.37500% 15-28.04.21*	USD	1 400 000			1 400 000	1 294 528	0,08	
SCHLUMBERGER HOLDINGS CORP-144A 4.00000% 15-21.12.25*	USD	248 000		248 000				
SCHLUMBERGER HOLDINGS CORP-144A 3.90000% 19-17.05.28*	USD	3 763 000	195 000		3 958 000	3 915 476	0,25	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 3.30000% 16-15.09.46*	USD	2 050 000			2 050 000	2 114 467	0,14	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 0.85000% 20-02.09.25*	USD		5 800 000		5 800 000	5 321 929	0,34	
SWEDBANK AB-144A 1.30000% 20-02.06.23*	USD		7 000 000		7 000 000	6 541 116	0,42	
SYSCO CORP 3.75000% 15-01.10.25*	USD	1 300 000		1 300 000				
UNION PACIFIC CORP-144A 2.97300% 20-16.09.62*	USD	1 300 000			1 300 000	1 172 219	0,08	
UPIJOHN INC-144A 1.65000% 20-22.06.25*	USD		3 000 000	3 000 000				
UPIJOHN INC-REG-S 1.12500% 20-22.06.22*	USD		5 000 000		5 000 000	4 629 064	0,30	
UPIJOHN INC-REG-S 1.65000% 20-22.06.25*	USD		1 600 000		1 600 000	1 504 754	0,10	
UPIJOHN INC-REG-S 3.85000% 20-22.06.40*	USD		2 400 000		2 400 000	2 381 585	0,15	
UPIJOHN INC-REG-S 4.00000% 20-22.06.50*	USD		3 700 000	3 700 000				
VERISK ANALYTICS INC 3.62500% 20-15.05.50*	USD		1 100 000		1 100 000	1 146 317	0,07	
WILLIS NORTH AMERICA INC 4.50000% 18-15.09.28*	USD	2 000 000			2 000 000	2 184 807	0,14	
Total USD						173 385 011	11,13	
Total Notes, fester Zins						175 535 803	11,27	
Notes, variabler Zins								
USD								
BNP PARIBAS SA-REG-S 2.219%/VAR 20-09.06.26*	USD		4 300 000		4 300 000	4 073 844	0,26	
MPLX LP 3M LIBOR+110BP 19-09.09.22*	USD	3 800 000			3 800 000	3 491 391	0,22	
PARTNERRE FINANCE B LLC-SUB 4.500%/VAR 20-01.10.50*	USD	3 800 000	2 000 000		1 800 000	1 660 444	0,11	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BK AB-144A 3M LIBOR+43BP 18-17.05.21*	USD	4 200 000			4 200 000	3 869 013	0,25	
STATE STREET CORP-144A 3.152%/VAR 20-30.03.31*	USD		2 100 000		2 100 000	2 200 945	0,14	
Total USD						15 295 636	0,98	
Total Notes, variabler Zins						15 295 636	0,98	
Medium-Term Notes, fester Zins								
CAD								
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.42000% 17-01.12.26*	CAD	4 500 000		4 500 000				
ENBRIDGE INC 2.99000% 19-03.10.29*	CAD		2 500 000	2 500 000				
Total CAD							0,00	
USD								
BPCE SA-144A 3.25000% 18-11.01.28*	USD	3 500 000		3 500 000				
BPCE SA-144A-SUB 4.87500% 16-01.04.26*	USD	2 000 000	200 000		2 200 000	2 301 893	0,15	
BPCE SA-REG-S 3.50000% 17-23.10.27*	USD	2 800 000			2 800 000	2 826 567	0,18	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-144A 3.87500% 14-15.04.24*	USD	2 050 000		2 050 000				
KEYCORP 2.90000% 15-15.09.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 2.62500% 15-17.11.20*	USD	2 500 000			2 500 000	2 303 697	0,15	
Total USD						7 432 157	0,48	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						7 432 157	0,48	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
USD								
BPCE SA 3M LIBOR+88BP 17-31.05.22*	USD	4 500 000			4 500 000	4 181 372	0,27	
GOLDMAN SACHS GROUP 3M LIBOR+160BP 13-29.11.23*	USD	1 800 000		1 800 000				
Total USD						4 181 372	0,27	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						4 181 372	0,27	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Anleihen, fester Zins								
USD								
AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.37500% 12-16.07.42*	USD	1 600 000		1 600 000				
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 4.37500% 12-01.09.42*	USD	750 000			750 000	869 284	0,06	
FEDEX CORP 4.90000% 14-15.01.34*	USD	1 850 000		1 850 000				
PUBLIC SERVICE CO OF COLORADO 2.70000% 20-15.01.51*	USD		5 400 000		5 400 000	5 042 685	0,32	
Total USD						5 911 969	0,38	
Total Anleihen, fester Zins						5 911 969	0,38	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						208 356 937	13,38	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

CAD								
BANK OF NOVA SCOTIA 2.29000% 17-28.06.24**	CAD	4 500 000			4 500 000	3 256 058	0,21	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 3.00000% 19-08.02.29**	CAD	4 500 000			4 500 000	3 437 900	0,22	
Total CAD						6 693 958	0,43	
USD								
NEWCREST FINANCE PTY LTD-144A 3.25000% 20-13.05.30**	USD		2 700 000		2 700 000	2 704 154	0,17	2 700 000
NUTRITION & BIOSCIENCES INC.-144A 1.83200% 20-15.10.27**	USD		2 600 000		2 600 000	2 399 580	0,15	
ROYALTY PHARMA PLC-144A 1.20000% 20-02.09.25**	USD		5 000 000		5 000 000	4 579 216	0,29	
Total USD						9 682 950	0,62	
Total Notes, fester Zins						16 376 908	1,05	

Medium-Term Notes, fester Zins

CAD								
ALTAGAS LTD 4.40000% 14-15.03.24**	CAD	4 500 000			4 500 000	3 386 953	0,22	
INTER PIPELINE LTD 2.73400% 17-18.04.24**	CAD	4 500 000			4 500 000	3 184 034	0,20	
Total CAD						6 570 987	0,42	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						6 570 987	0,42	

Anleihen, fester Zins

JPY								
BERKSHIRE HATHAWAY INC 1.10800% 19-13.09.49**	JPY	500 000 000			500 000 000	3 874 752	0,25	
Total JPY						3 874 752	0,25	
Total Anleihen, fester Zins						3 874 752	0,25	

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Total Wertschriften (davon ausgeliehen)						1 453 846 774	93,35	
						195 482 620	12,55)	
Bankguthaben auf Sicht						95 453 996	6,13	
Derivative Finanzinstrumente						-248 696	-0,02	
Sonstige Vermögenswerte						8 421 917	0,54	
Gesamtfondsvermögen						1 557 473 991	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-7 318 821		
Andere Verbindlichkeiten						-760 397		
Nettofondsvermögen						1 549 394 773		

Bewertungskategorie

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 426 716 916	91,61
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	26 881 162	1,72
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	1 453 598 078	93,33

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 08.12.20*	-595	EUR	-111 873 682	-314 108	-0,02
EURO-BOBL FUTURE 08.12.20*	-40	EUR	-5 825 136	-1 293	0,00
			-117 698 818	-315 401	-0,02

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
LONG GILT FUTURE 29.12.20*	65	GBP	10 508 291	-21 617	0.00
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.20*	150	CAD	15 662 598	-10 317	0.00
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20*	260	USD	30 105 715	59 719	0.00
US LONG BOND FUTURE 21.12.20*	150	USD	24 293 760	-27 563	0.00
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20*	150	USD	19 229 150	74 289	0.00
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.20*	30	USD	6 113 707	-66 322	0.00
			105 913 221	8 189	0.00

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
GOLDMAN SACHS/CDX.NA.IG.34 CDI PAYER 1.000000% 20-20.06.25**	5 000 000	USD	4 623 766	-31 164	-0.01
			4 623 766	-31 164	-0.01

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 110 475 807

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
USD	200 000 000	CHF	182 768 000	13.10.2020	-933 385	-0.06
USD	15 000 000	CHF	13 619 115	13.10.2020	-158 489	-0.01
CAD	19 900 000	CHF	13 701 765	14.10.2020	18 496	0.00
USD	14 000 000	CHF	13 172 592	20.10.2020	316 095	0.02
USD	286 000 000	CHF	269 196 928	20.10.2020	6 557 062	0.42
EUR	218 000 000	CHF	235 151 630	20.10.2020	314 635	0.02
EUR	8 000 000	CHF	8 628 115	20.10.2020	10 244	0.00
EUR	20 000 000	CHF	21 492 214	20.10.2020	-52 464	0.00
USD	10 000 000	CHF	9 104 277	20.10.2020	-78 935	-0.01
USD	5 000 000	CHF	4 516 695	20.10.2020	-74 911	0.00
JPY	850 000 000	CHF	7 274 623	30.10.2020	-121 830	-0.01
USD	169 000 000	CHF	153 273 367	16.11.2020	-1 789 472	-0.11
EUR	27 000 000	CHF	29 064 852	16.11.2020	-14 236	0.00
GBP	53 300 000	CHF	62 702 653	23.11.2020	-527 147	-0.03
EUR	205 000 000	CHF	220 672 865	23.11.2020	-99 636	-0.01
USD	304 000 000	CHF	275 584 816	23.11.2020	-3 276 347	-0.21
					89 680	0.01

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 06.12.19	EUR	420	135
EURO-BOBL FUTURE 06.12.19	EUR	120	0
EURO-BUXL FUTURE 06.12.19	EUR	70	26
EURO-BUND FUTURE 06.03.20	EUR	500	500
EURO-BOBL FUTURE 06.03.20	EUR	120	120
EURO-BUXL FUTURE 06.03.20	EUR	28	28
EURO-BUND FUTURE 08.06.20	EUR	560	560
EURO-BOBL FUTURE 08.06.20	EUR	120	120
EURO-BUND FUTURE 08.09.20	EUR	680	680
EURO-BOBL FUTURE 08.09.20	EUR	120	120
EURO-BUND FUTURE 08.12.20	EUR	0	595
EURO-BOBL FUTURE 08.12.20	EUR	0	40
US LONG BOND FUTURE 19.12.19	USD	108	50
US LONG BOND FUTURE 20.03.20	USD	108	108
US LONG BOND FUTURE 19.06.20	USD	473	473
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.09.20	USD	65	65
US LONG BOND FUTURE 21.09.20	USD	255	255
US LONG BOND FUTURE 21.12.20	USD	2	2
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.20	USD	65	65

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 08.06.20	EUR	50	50
LONG GILT FUTURE 26.06.20	GBP	20	20
LONG GILT FUTURE 28.09.20	GBP	90	90
LONG GILT FUTURE 29.12.20	GBP	65	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.19	USD	140	440
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.19	USD	0	150
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.19	USD	0	50
CANADA 10YR BOND FUTURE 20.03.20	CAD	120	120
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	USD	250	250
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	USD	150	150
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	USD	1 100	1 100
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.06.20	USD	1 800	1 800
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	250	250
US LONG BOND FUTURE 19.06.20	USD	165	165
CAN 10YR BOND FUTURE 19.06.20	CAD	150	150
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.20	USD	410	410
US LONG BOND FUTURE 21.09.20	USD	510	510
CAN 10YR BOND FUTURE 21.09.20	CAD	150	150
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.09.20	USD	1 070	1 070
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.20	CAD	150	0

Jahresbericht per 30. September 2020

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20	USD	260	0
US LONG BOND FUTURE 21.12.20	USD	200	50
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.12.20	USD	150	0
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.12.20	USD	30	0

Instrument	Währung	Nominal
------------	---------	---------

Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps

GOLDMAN SACHS/CDX.NA.IG.34 CDI PAYER 1.00000% 20-20.06.25	USD	5 000 000
---	-----	-----------

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
--------------------	-------------------	-----------------	----------------	------------

Devisentermingeschäfte

GBP	1 200 000	CHF	1 464 898	18.11.2019
GBP	39 500 000	CHF	49 454 130	18.11.2019
EUR	13 000 000	CHF	14 318 070	18.11.2019
EUR	5 500 000	CHF	6 059 267	18.11.2019
CHF	5 121 096	GBP	4 000 000	18.11.2019
JPY	1 107 000 000	CHF	10 073 423	25.11.2019
CAD	2 150 000	CHF	1 619 677	27.11.2019
USD	9 000 000	CHF	8 876 070	27.11.2019
EUR	6 100 000	CHF	6 642 267	16.12.2019
GBP	36 800 000	CHF	46 709 088	18.12.2019
EUR	331 500 000	CHF	360 491 167	18.12.2019
CHF	1 805 853	GBP	1 400 000	18.12.2019
CHF	4 502 961	USD	4 500 000	18.12.2019
CHF	11 229 353	EUR	10 200 000	18.12.2019
CAD	25 600 000	CHF	19 140 506	07.01.2020
USD	334 000 000	CHF	332 120 916	10.01.2020
USD	2 000 000	CHF	1 970 786	10.01.2020
USD	600 000	CHF	590 089	10.01.2020
JPY	1 107 000 000	CHF	10 104 098	27.01.2020
CAD	25 600 000	CHF	19 132 442	07.02.2020
USD	352 000 000	CHF	340 874 336	10.02.2020
EUR	325 100 000	CHF	355 953 290	19.02.2020
GBP	35 100 000	CHF	45 989 845	19.02.2020
EUR	2 000 000	CHF	2 181 224	19.02.2020
GBP	8 650 000	CHF	11 015 239	19.02.2020
GBP	4 900 000	CHF	6 181 144	19.02.2020
EUR	5 000 000	CHF	5 476 183	20.02.2020
USD	298 000 000	CHF	291 870 259	20.02.2020
USD	15 000 000	CHF	14 488 436	20.02.2020
USD	12 000 000	CHF	11 665 710	20.02.2020
CAD	26 000 000	CHF	18 982 418	09.03.2020
USD	355 000 000	CHF	345 403 321	10.03.2020
GBP	49 300 000	CHF	62 913 909	19.03.2020
EUR	348 000 000	CHF	370 270 016	19.03.2020
GBP	2 500 000	CHF	3 153 456	19.03.2020
CHF	10 672 540	EUR	10 000 000	19.03.2020
CHF	482 632	GBP	400 000	19.03.2020
CHF	2 109 593	EUR	2 000 000	19.03.2020
CHF	1 585 782	EUR	1 500 000	19.03.2020
CHF	1 545 001	GBP	1 300 000	19.03.2020
CHF	22 187 529	EUR	21 000 000	19.03.2020
USD	323 000 000	CHF	316 431 149	20.03.2020
CHF	96 136 000	USD	100 000 000	20.03.2020
JPY	1 103 000 000	CHF	9 734 718	27.03.2020
USD	332 000 000	CHF	311 535 686	14.04.2020
USD	4 500 000	CHF	4 164 179	14.04.2020
CHF	9 379 140	USD	10 000 000	14.04.2020
CHF	12 152 621	USD	13 000 000	14.04.2020
CHF	14 128 220	USD	15 000 000	14.04.2020
CHF	9 818 374	USD	10 000 000	14.04.2020
CHF	281 781 400	USD	290 000 000	14.04.2020
CHF	1 044 609	GBP	900 000	20.04.2020
EUR	100 000 000	CHF	105 582 500	20.04.2020
GBP	49 000 000	CHF	56 643 799	20.04.2020
EUR	100 000 000	CHF	105 408 950	20.04.2020
EUR	100 000 000	CHF	105 458 000	20.04.2020
USD	100 000 000	CHF	95 851 800	20.04.2020
USD	100 000 000	CHF	95 977 000	20.04.2020
CHF	1 139 090	GBP	1 000 000	20.04.2020
CHF	8 429 669	EUR	8 000 000	20.04.2020
CHF	14 574 848	USD	15 000 000	20.04.2020
CHF	2 489 192	GBP	2 200 000	20.04.2020
GBP	100 000	CHF	116 068	20.04.2020
USD	33 000 000	CHF	31 687 214	20.04.2020
EUR	10 000 000	CHF	10 595 442	20.04.2020
CHF	17 000 000	USD	17 575 234	20.04.2020
GBP	2 500 000	CHF	3 004 608	20.04.2020
USD	25 000 000	CHF	24 426 953	20.04.2020
EUR	20 000 000	CHF	21 130 624	20.04.2020
USD	10 000 000	CHF	9 702 638	20.04.2020
USD	40 000 000	CHF	38 563 244	20.04.2020
EUR	10 000 000	CHF	10 537 839	20.04.2020
USD	17 000 000	CHF	16 181 656	11.05.2020
CAD	26 700 000	CHF	18 859 150	11.05.2020
CHF	337 731	CAD	500 000	11.05.2020
CHF	867 922	CAD	1 300 000	11.05.2020
CHF	346 402	CAD	500 000	11.05.2020
CHF	3 850 900	CAD	5 500 000	11.05.2020
CHF	4 236 752	EUR	4 000 000	19.05.2020
USD	100 000 000	CHF	96 622 000	20.05.2020

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	165 000 000	CHF	173 452 125	20.05.2020
GBP	43 000 000	CHF	51 876 361	20.05.2020
EUR	5 000 000	CHF	5 258 585	20.05.2020
USD	23 000 000	CHF	22 321 868	20.05.2020
CHF	2 429 132	GBP	2 000 000	20.05.2020
CHF	21 197 400	EUR	20 000 000	26.05.2020
JPY	1 115 000 000	CHF	9 870 147	29.05.2020
CHF	446 236	JPY	50 000 000	29.05.2020
USD	290 000 000	CHF	281 106 280	15.06.2020
USD	15 000 000	CHF	14 647 389	15.06.2020
USD	4 000 000	CHF	3 895 185	15.06.2020
USD	8 000 000	CHF	7 734 478	15.06.2020
USD	23 000 000	CHF	22 191 205	15.06.2020
CHF	321 666 928	USD	340 000 000	15.06.2020
USD	90 000 000	CHF	85 801 572	19.06.2020
EUR	172 000 000	CHF	180 920 642	22.06.2020
USD	130 000 000	CHF	126 049 755	22.06.2020
CAD	19 000 000	CHF	13 185 134	13.07.2020
EUR	171 000 000	CHF	179 675 856	20.07.2020
USD	174 000 000	CHF	167 589 840	20.07.2020
EUR	12 000 000	CHF	12 627 822	20.07.2020
GBP	42 000 000	CHF	49 545 972	20.07.2020
EUR	20 000 000	CHF	21 187 584	20.07.2020
USD	66 000 000	CHF	64 070 233	20.07.2020
USD	20 000 000	CHF	19 372 860	20.07.2020
USD	25 000 000	CHF	24 030 700	20.07.2020
EUR	14 000 000	CHF	15 054 130	20.07.2020
GBP	6 000 000	CHF	7 083 010	20.07.2020
GBP	6 300 000	CHF	7 450 487	20.07.2020
USD	349 000 000	CHF	329 595 426	12.08.2020
EUR	16 000 000	CHF	17 198 112	12.08.2020
EUR	10 000 000	CHF	10 629 880	12.08.2020
USD	10 000 000	CHF	9 231 290	12.08.2020
USD	95 000 000	CHF	90 050 538	19.08.2020
EUR	201 000 000	CHF	214 474 839	19.08.2020
USD	140 000 000	CHF	133 028 238	19.08.2020
USD	35 000 000	CHF	32 896 115	19.08.2020
USD	12 000 000	CHF	11 263 992	19.08.2020
EUR	5 000 000	CHF	5 392 066	19.08.2020
USD	6 000 000	CHF	5 490 228	19.08.2020
CHF	7 288 154	USD	8 000 000	19.08.2020
JPY	1 065 000 000	CHF	9 562 534	31.08.2020
CHF	85 967	JPY	10 000 000	31.08.2020
CAD	19 700 000	CHF	13 623 511	14.09.2020
USD	174 000 000	CHF	159 129 664	14.09.2020
EUR	26 000 000	CHF	27 968 582	14.09.2020
GBP	54 000 000	CHF	64 097 017	21.09.2020
EUR	200 000 000	CHF	214 907 800	21.09.2020
USD	272 000 000	CHF	246 772 272	21.09.2020
USD	30 000 000	CHF	27 354 990	21.09.2020
USD	200 000 000	CHF	182 768 000	13.10.2020
USD	15 000 000	CHF	13 619 115	13.10.2020
CAD	19 900 000	CHF	13 701 765	14.10.2020
USD	14 000 000	CHF	13 172 592	20.10.2020
USD	286 000 000	CHF	269 196 928	20.10.2020
EUR	218 000 000	CHF	235 151 630	20.10.2020
EUR	8 000 000	CHF	8 628 115	20.10.2020
EUR	20 000 000	CHF	21 492 214	20.10.2020
USD	10 000 000	CHF	9 104 277	20.10.2020
USD	5 000 000	CHF	4 516 695	20.10.2020
JPY	850 000 000	CHF	7 274 623	30.10.2020
USD	169 000 000	CHF	153 273 367	16.11.2020
EUR	27 000 000	CHF	29 064 852	16.11.2020
GBP	53 300 000	CHF	62 702 653	23.11.2020
EUR	205 000 000	CHF	220 672 865	23.11.2020
USD	304 000 000	CHF	275 584 816	23.11.2020

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagementerhöhende Positionen	105 913 221,19	6,84%
Total engagementreduzierende Positionen	1 643 208 028,73	106,05%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,1425% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,5225% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,35% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,65% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,15%
Klasse I-A2:	0,53%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF	0.687816	JPY 1 = CHF	0.008706
EUR 1 = CHF	1.077372	USD 1 = CHF	0.918750
GBP 1 = CHF	1.187760		

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		597 814 848,27	579 714 793,68	523 593 222,76
Klasse I-A1	CH0023989764			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 140,60	1 166,74	1 097,52
Anzahl Anteile im Umlauf		505 200,0000	471 427,0000	452 300,0000
Klasse I-A2	CH0324001053			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		999,63	1 022,50	961,99
Anzahl Anteile im Umlauf		21 590,0000	29 028,0000	28 258,0000

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	-1.5%	7.3%	-1.0%
Klasse I-A2	CHF	-1.7%	7.1%	-1.2%
Referenzindex:				
Swiss Bond Index Domestic AAA – BBB	CHF	-1.4%	7.3%	-0.9%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Die Corona-Pandemie führte am Schweizer Kapitalmarkt zu erheblichen Turbulenzen. Während die Risikoprämien für Unternehmensanleihen zu Beginn der Berichtsperiode kontinuierlich abnahmen, führte der Ausbruch der Corona-Pandemie zu einem schlagartigen Anstieg. Innert kürzester Zeit verdreifachten sich die Kreditprämien. Gleichzeitig kam es auch zu einem Anstieg der Zinssätze, da nur noch Anleihen der Schweizerischen Eidgenossenschaft und kurzlaufende Obligationen bester Qualität zur Beschaffung von Liquidität verkauft werden konnten. Die tiefe Marktliquidität führte zu sehr hohen Geld-Brief-Spannen, welche oftmals fünf, zehn oder noch mehr Prozentpunkte betragen. Die Hilfsmassnahmen der Notenbanken und Regierungen führten ab April zu einer Beruhigung der Situation. In der Folge nahmen die Zinssätze und Kreditprämien wieder ab, und die Marktliquidität normalisierte sich. Über den ganzen Zeitraum der Berichtsperiode erhöhten sich die Zinssätze wie auch die Kreditprämien leicht. Dieser Umstand führte zu einer negativen absoluten Rendite des Anlagefonds. Aus relativer Sicht ist das Ergebnis ausgeglichen. Das höhere Kreditrisiko lieferte zwar einen negativen Ergebnisbeitrag aufgrund der Ausweitung der Kreditspannen, dafür konnte dadurch, wie auch durch die Zinskurvenpositionierung, eine höhere laufende Rendite erzielt werden.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	97,67
Liechtenstein	1,47
Italien	0,26
Total	99,40

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	3 505 627.72 ¹	5 094 133.23 ²
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	600 499 842.25	585 401 403.96
Derivative Finanzinstrumente	-2 264 961.08	-2 514 730.17
Sonstige Vermögenswerte	2 326 344.16	2 213 388.74
Gesamtfondsvermögen	604 066 853.05	590 194 195.76
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-6 118 585.83	-10 337 532.50
Andere Verbindlichkeiten	-133 418.95	-141 869.58
Nettofondsvermögen	597 814 848.27	579 714 793.68

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Negativzinsen	-20 814.78	-38 692.72
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	3 738 934.80	4 208 021.28
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	369 051.40	218 686.84
Erträge der Effektenleihe	61 984.20	70 438.30
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	31.99	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	264 378.02	489 454.15
Total Ertrag	4 413 565.63	4 947 907.85
Aufwand		
Passivzinsen	-3 712.76	30 011.49 ³
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-412 948.51	-367 069.18
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-59 270.00	-102 360.30
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-44 412.30	-40 897.16
Sonstige Aufwendungen	-389.00	-264.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-228 490.28	-304 962.01
Total Aufwand	-749 222.85	-785 541.16
Nettoertrag	3 664 342.78	4 162 366.69
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	964 219.43	2 734 766.64
Realisierter Erfolg	4 628 562.21	6 897 133.33
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-13 930 704.39	31 923 064.76
Gesamterfolg	-9 302 142.18	38 820 198.09

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	3 664 342.78	4 162 366.69
Vortrag des Vorjahres	56 115.19	60 532.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3 720 457.97	4 222 898.69
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-3 633 555.00	-4 166 783.50
Vortrag auf neue Rechnung	86 902.97	56 115.19

¹ Zum 30. September 2020 wurden gegenüber Zürcher Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 260 000 und gegenüber Basler Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 1 230 000 als Sicherheiten hinterlegt.

² Zum 30. September 2019 wurden gegenüber Zürcher Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 260 000 und gegenüber Basler Kantonalbank Bankguthaben in Höhe von CHF 1 230 000 als Sicherheiten hinterlegt.

³ Die Passivzinsen per 30.9.2019 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 32 135.88

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	579 714 793.68	523 593 222.76
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 281 234.00	-4 666 690.50
Saldo aus dem Anteilverkehr	31 683 430.77	21 968 063.33
Gesamterfolg	-9 302 142.18	38 820 198.09
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	597 814 848.27	579 714 793.68

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	471 427,0000	452 300,0000
Ausgegebene Anteile	75 892,0000	123 420,0000
Zurückgenommene Anteile	-42 119,0000	-104 293,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	505 200,0000	471 427,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	33 773,0000	19 127,0000
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	29 028,0000	28 258,0000
Ausgegebene Anteile	12 437,0000	23 595,0000
Zurückgenommene Anteile	-19 875,0000	-22 825,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	21 590,0000	29 028,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-7 438,0000	770,0000

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	7.1635
Brutto	CHF	7.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-2.4500
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	4.5500

Klasse I-A2

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	4.6985
Brutto	CHF	4.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-1.5750
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	2.9250

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Asset Backed Securities, fester Zins							
CHF							
SWISS AUTO LEASE GMBH-REG-S STEP-UP 20-23.03.30*	CHF	4 000 000		4 000 000	3 922 000	0,65	
SWISS CAR ABS-REG-S 0.12000% 18-18.04.28*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 989 873	0,33	
SWISS CREDIT CARD ISSUANCE 2019-REG-S 0.04000% 19-15.06.24*	CHF	3 150 000		3 150 000	3 079 064	0,51	
Total CHF					8 990 937	1,49	
Total Asset Backed Securities, fester Zins					8 990 937	1,49	
Asset Backed Securities, variabler Zins							
CHF							
FIRST SWISS MOBILITY AG-REG-S STEP-UP 20-15.02.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 952 000	0,32	
Total CHF					1 952 000	0,32	
Total Asset Backed Securities, variabler Zins					1 952 000	0,32	
Notes, fester Zins							
CHF							
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.87500% 15-23.01.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 086 500	0,18	
AKEB AG FUER KERNENERGIE BETEILIG-REG-S 1.45000% 20-23.07.27*	CHF		2 220 000	2 220 000	2 287 710	0,38	915 000
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.40000% 19-26.09.29*	CHF	2 000 000		1 000 000	985 500	0,16	
ALPIQ HOLDING LTD 2.12500% 15-30.06.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 038 000	0,17	
ALPIQ HOLDING LTD 3.00000% 12-16.05.22*	CHF		1 000 000	1 000 000			
ENERGIEFINANZIERUNGS AG 2.62500% 11-31.01.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 033 000	0,17	250 000
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 1.00000% 20-28.04.23*	CHF		850 000	850 000			
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF		1 090 000	1 090 000	1 095 995	0,18	
LUZERNER KANTONALBANK 2.12500% 11-04.10.41*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 398 500	0,23	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-21.01.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 045 200	0,17	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 18-09.10.28*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 195 600	0,53	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 18-16.11.26*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 578 250	0,43	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 20-08.05.29*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 069 000	0,51	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERI HYPO INST-REG-S 0.12500% 20-14.10.33*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 039 000	0,50	
PFANDBRIEFBK SCHZ HYPO INST-REG-S 0.37500% 18-10.07.28*	CHF	5 000 000		2 000 000	3 131 700	0,52	3 000 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.75000% 13-25.02.26*	CHF	900 000		900 000	1 001 610	0,17	
REPOWER AG 2.37500% 10-20.07.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 022 500	0,17	
SULZER AG-REG-S 0.80000% 20-23.09.25*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 011 000	0,33	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.20000% 19-29.01.27*	CHF	2 000 000		2 000 000			
ZURICH, CITY OF 1.75000% 14-06.03.29*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 746 750	0,29	
Total CHF					30 765 815	5,09	
Total Notes, fester Zins					30 765 815	5,09	
Notes, Nullcoupon							
CHF							
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-31.10.30*	CHF	4 000 000	3 000 000	1 000 000	1 000 000	0,17	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO 0.00000% 19-15.06.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 032 000	0,34	
Total CHF					3 032 000	0,50	
Total Notes, Nullcoupon					3 032 000	0,50	
Medium-Term Notes, fester Zins							
CHF							
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.05000% 20-28.01.31*	CHF		2 000 000	2 000 000	2 008 000	0,33	
CRH FINANCE SWITZERLAND AG-REG-S 1.37500% 14-30.09.22*	CHF	1 000 000		1 000 000			
KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG-REG-S 2.00000% 19-14.02.25*	CHF	500 000		500 000	526 500	0,09	290 000
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FINANCE-REG-S 1.05000% 20-11.04.22*	CHF		1 000 000	1 000 000			
LGT BANK AG-REG-S 0.37500% 19-05.07.28*	CHF	800 000		800 000	815 200	0,13	800 000
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.35000% 18-05.02.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 066 000	0,34	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.10000% 18-08.05.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
MIGROS BANK AG-REG-S 0.25000% 19-10.12.27*	CHF		1 300 000	1 300 000	1 307 150	0,22	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 12-27.04.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 233 200	0,37	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 16-17.05.40*	CHF	750 000		750 000	777 000	0,13	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 17-21.12.29*	CHF	500 000		500 000	528 350	0,09	500 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-12.10.27*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 134 000	0,68	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.25000% 17-18.09.26*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 128 000	0,68	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 18-12.05.27*	CHF	5 000 000		5 000 000	5 205 500	0,86	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.00000% 12-09.09.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 030 000	0,17	
SWISS REINSURANCE CO LTD 0.75000% 15-21.01.27*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 107 000	0,35	
Total CHF					26 865 900	4,45	
Total Medium-Term Notes, fester Zins					26 865 900	4,45	
Anleihen, fester Zins							
CHF							
AAREKRAFTWERK KLINGNAU AG-REG-S 0.62500% 19-03.08.29*	CHF	1 400 000		1 400 000	1 410 500	0,23	
AARGAU, CANTON OF 0.25000% 15-11.12.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 045 500	0,17	300 000
AARGAUISCHE KANTONALBANK 1.60000% 12-18.05.37*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 241 500	0,21	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.62500% 15-13.04.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 054 500	0,17	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.12500% 19-11.02.26*	CHF	1 000 000		1 000 000			
ABB LTD-REG-S 0.30000% 19-06.08.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
ABB LTD-REG-S 1.00000% 19-07.05.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 068 000	0,18	645 000
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 0.31000% 19-27.06.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 940 000	0,32	
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 1.05000% 20-26.05.23*	CHF		2 000 000	1 000 000	1 016 000	0,17	
ALLREAL HOLDING AG 0.87500% 17-30.03.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 024 000	0,17	
ALLREAL HOLDING AG 1.37500% 15-31.03.25*	CHF	1 000 000		1 000 000			
ALLREAL HOLDING AG-REG-S 0.70000% 20-22.09.28*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 030 000	0,50	
ALPIQ HOLDING AG 2.62500% 14-29.07.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 061 500	0,18	
AMAG LEASING AG-REG-S 0.50000% 19-12.11.25*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 474 500	0,24	35 000

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
AXPO HOLDING AG 1.00200% 20-23.07.27*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 075 000	0,51	
AXPO HOLDING AG 1.75000% 16-29.05.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 042 500	0,17	
BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.50000% 19-28.11.25*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 024 000	0,17	
BANCA DELLO STATO CANTONE TICINO 0.30000% 17-15.06.27*	CHF	1 000 000	1 000 000				
BANCA DELLO STATO CANTONE TICINO-REG-S 0.37500% 18-08.02.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 017 000	0,17	
BANCA DELLO STATO CANTONE TICINO-REG-S 0.45000% 19-26.02.29*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 054 000	0,34	
BANK CLER AG-REG-S 0.50000% 17-28.11.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 027 000	0,17	210 000
BANQUE CANTONALE DE GENEVE 0.50000% 15-10.06.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
BANQUE CANTONALE DE GENEVE-SUB 1.12500% 17-28.06.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 045 500	0,17	50 000
BANQUE CANTONALE DU JURA 0.62500% 15-04.03.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 022 500	0,17	
BANQUE CANTONALE NEUCHATELOISE-REG-S 0.35000% 18-14.09.26*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 029 000	0,17	
BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.62500% 11-30.11.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 104 500	0,18	935 000
BANQUE CANTONALE VAUDOISE 0.50000% 16-13.12.28*	CHF	1 040 000		1 040 000	1 076 400	0,18	
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF-REG-S 1.00000% 14-30.03.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 091 000	0,18	
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF 0.62500% 15-26.06.36*	CHF	600 000		600 000	662 400	0,11	
BASEL-STADT, CANTON OF 0.50000% 15-23.02.35*	CHF	600 000		600 000	649 500	0,11	
BASEL-STADT, CANTON OF-REG-S 0.50000% 19-22.02.34*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 162 000	0,36	635 000
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.25000% 18-25.01.27*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 026 000	0,17	200 000
BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONAL-REG-S 0.25000% 19-04.08.27*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 539 000	0,25	
BASLER KANTONALBANK 0.30000% 17-22.06.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 032 000	0,17	
BASLER KANTONALBANK 0.15000% 19-02.04.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 020 000	0,17	
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 18-11.04.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 014 500	0,17	
BELL FOOD GROUP AG 0.62500% 16-24.03.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 015 000	0,17	
BELL FOOD GROUP AG-REG-S 0.37500% 18-01.02.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 008 000	0,17	
BERN, CANTON OF 0.50000% 17-28.09.37*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 090 000	0,18	
BERN, CANTON OF 1.25000% 14-22.04.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 063 000	0,18	
BERN, CANTON OF 1.25000% 14-12.09.30*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 148 500	0,19	450 000
BERN, CANTON OF 1.75000% 10-24.09.25*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 216 400	0,37	
BERN, CITY OF 0.50000% 16-31.03.36*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 064 000	0,18	
BERNER KANTONALBANK AG 0.40000% 18-03.05.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 029 500	0,17	120 000
BERNER KANTONALBANK AG 0.10000% 19-30.09.39*	CHF	2 000 000		2 000 000	1 940 000	0,32	
BIEL, CITY OF 1.37500% 14-24.09.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 127 000	0,19	
BIEL, CITY OF 2.62500% 06-03.03.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 153 000	0,19	
BKW AG-REG-S 0.75000% 18-15.10.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 036 000	0,17	
BLS AG-REG-S 0.40000% 18-12.12.28*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 642 500	0,44	
BOBST GROUP SA-REG-S 1.50000% 14-30.09.20*	CHF	1 000 000	1 000 000				
BOBST GROUP SA-REG-S 0.50000% 20-17.02.26*	CHF	1 200 000		1 200 000	1 173 600	0,19	
BUCHER INDUSTRIES AG 1.37500% 14-02.10.24*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 559 250	0,26	355 000
CANTON OF GRAUBUENDEN 0.25000% 15-26.11.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 044 000	0,17	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.25000% 17-23.05.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 004 000	0,17	355 000
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.28500% 19-19.08.27*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 604 000	0,27	225 000
CITY OF BERN SWITZERLAND-REG-S 0.70000% 19-30.01.34*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 627 500	0,27	
CLIENTIS AG 0.50000% 15-29.06.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 008 000	0,17	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26*	CHF	950 000		950 000	963 775	0,16	179 991
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.75000% 18-06.06.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 027 500	0,17	20 000
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.75000% 20-05.05.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 020 500	0,17	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.25000% 20-16.06.28*	CHF	2 150 000	2 150 000				
EBM NETZ AG 0.25000% 17-08.08.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	999 500	0,17	
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.45000% 17-11.07.22*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 000 500	0,17	
EMISSIONS- UND FINANZ AG 0.87500% 18-18.10.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 011 000	0,17	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRAEGER 0.87500% 12-24.03.23*	CHF	1 500 000	1 500 000				
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRAEGER 0.75000% 14-24.09.24*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 144 000	0,52	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRAEGER 1.12500% 14-24.09.29*	CHF	800 000		800 000	900 000	0,15	800 000
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTRAEGER 0.62500% 15-07.09.33*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 096 500	0,18	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTR-REG-S 0.44000% 19-28.05.37*	CHF	800 000		800 000	863 600	0,14	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTR-REG-S 0.35000% 20-27.04.40*	CHF	1 000 000	1 000 000				
EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 2.87500% 05-04.02.30*	CHF	1 000 000	1 000 000				
FCA CAPITAL SUISSE SA-REG-S 0.10000% 19-23.10.23*	CHF	1 600 000		1 600 000	1 557 600	0,26	
FIRMENICH INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 20-19.12.23*	CHF	1 500 000	500 000	1 000 000	1 022 000	0,17	
FLUGHAFEN ZUERICH AG 1.50000% 13-17.04.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 033 500	0,17	
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.20000% 20-26.02.35*	CHF	1 000 000		1 000 000	946 500	0,16	
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.70000% 20-22.05.24*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 019 000	0,17	
FLUGHAFEN ZURICH AG 0.62500% 17-24.05.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 019 500	0,17	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.50000% 16-23.02.28*	CHF	1 500 000	500 000	1 000 000	1 045 500	0,17	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.20000% 18-20.02.26*	CHF	1 500 000	1 500 000				
FREIBURGER KANTONALBANK 0.14000% 20-12.06.30*	CHF	1 500 000	500 000	1 000 000	1 015 000	0,17	
GALENICA SANTE LTD 1.00000% 17-15.12.26*	CHF	840 000		840 000	861 840	0,14	
GEBERIT AG-REG-S 0.35000% 20-20.10.22*	CHF	1 000 000	1 000 000				
GEBERIT AG-REG-S 0.60000% 19-17.10.28*	CHF	600 000		600 000	623 400	0,10	
GENEVA, CANTON OF 0.50000% 15-27.11.30*	CHF	2 000 000	1 000 000	1 000 000	1 049 000	0,17	
GENEVA, CANTON OF 1.50000% 12-05.03.32*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 165 500	0,19	
GENEVA, CANTON OF 1.50000% 12-28.05.27*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 110 500	0,18	570 000
GENEVA, CANTON OF 1.75000% 13-22.03.33*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 213 500	0,20	
GENEVA, CANTON OF 1.75000% 13-24.05.34*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 451 000	0,41	
GENEVA, CANTON OF 2.12500% 10-27.10.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 180 500	0,20	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.50000% 17-28.11.31*	CHF	2 000 000		2 000 000	2 108 000	0,35	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.30000% 18-27.11.26*	CHF	2 500 000	1 500 000	1 000 000	1 030 000	0,17	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.05000% 20-15.11.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 009 000	0,17	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.25000% 20-15.06.40*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 525 500	0,25	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.05000% 20-15.11.29*	CHF	1 000 000	1 000 000				
GEORGES FISCHER FINANZ AG 2.50000% 13-12.09.22*	CHF	500 000		500 000	523 250	0,09	
GEORGES FISCHER FINANZ AG 0.87500% 16-12.05.26*	CHF	1 050 000		1 050 000	1 076 775	0,18	350 000
GRANDE DIXENCE SA 1.37500% 15-18.02.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 031 500	0,17	25 000
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 1.25000% 18-06.06.23*	CHF	750 000	750 000				
GRANDE DIXENCE SA-REG-S 0.80000% 19-17.06.26*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 001 000	0,17	180 000
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.62500% 15-20.04.29*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 058 000	0,18	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.25000% 16-10.03.28*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 026 000	0,17	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.12500% 18-29.05.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
GZO AG SPITAL WETZIKON 1.87500% 14-12.06.24*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 046 500	0,17	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG-REG-S 1.00000% 15-01.07.21*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 002 400	0,17	
HIAG IMMOBILIEN HOLDING AG 1.00000% 16-04.07.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 006 000	0,17	200 000
HILTI AG 0.20000% 17-08.11.24*	CHF	300 000	300 000				
HILTI AG 0.40000% 17-08.11.27*	CHF	650 000		650 000	662 025	0,11	
HILTI AG-REG-S 0.05000% 20-02.07.25*	CHF	1 800 000		1 800 000	1 811 700	0,30	
IMPLENIA AG-REG-S 1.62500% 14-15.10.24*	CHF	1 500 000	1 500 000				
INTERSHOP HOLDING AG 1.12500% 15-17.04.23*	CHF	1 000 000		1 000 000	1 011 500	0,17	235 000

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
INVESTIS HOLDING SA 0.55000% 16-15.11.21*	CHF 1 000 000			1 000 000	998 400	0,17	
INVESTIS HOLDING SA 0.75000% 17-03.10.22*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 004 500	0,17	
JULIUS BAER GROUP-REG-S 0.37500% 17-06.12.24*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 006 500	0,17	
JURA, CANTON OF-REG-S 0.15000% 20-22.05.30*	CHF 1 000 000	1 000 000		1 000 000	1 017 500	0,17	
KANTONSSPITAL AARAU AG-REG-S 0.70000% 18-23.05.28*	CHF 700 000			700 000	726 600	0,12	
KANTONSSPITAL AARAU AG-REG-S 1.10000% 18-23.05.33*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 070 000	0,18	
KERNKRAFTWERK GOESGEN-DAENIKEN 2.00000% 13-30.09.20*	CHF 1 000 000		1 000 000				
KERNKRAFTWERK GOESGEN-DAENIKEN-REG-S 0.93000% 20-30.09.27*	CHF 1 000 000	1 650 000		1 650 000	1 666 500	0,28	
KERNKRAFTWERK LEIBSTADT AG 1.50000% 15-16.12.22*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 017 000	0,17	
KINDERSPITAL ZUERICH-ELEONOREN-REG-S 0.25000% 16-28.07.28*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 010 000	0,17	
KINDERSPITAL ZUERICH-ELEONOREN-REG-S 0.75000% 16-28.07.36*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 035 000	0,17	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.87500% 11-30.06.31*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 186 000	0,20	20 000
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 1.25000% 14-11.09.24*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 027 000	0,17	150 000
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG 2.00000% 17-11.12.23*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 045 500	0,17	
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 1.87500% 13-21.02.25*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 142 000	0,35	
LAFARGEHOLCIM LTD 1.00000% 15-04.12.25*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 038 000	0,17	205 000
LAFARGEHOLCIM LTD-REG-S 1.00000% 18-11.12.24*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 031 500	0,17	200 000
LAUSANNE, CITY OF 0.62500% 15-04.03.30*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 052 500	0,17	
LAUSANNE, CITY OF 0.87500% 17-06.10.42*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 134 500	0,19	
LAUSANNE, CITY OF-REG-S 0.05000% 19-28.09.54*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 435 500	0,24	
LGT BANK AG 0.62500% 15-25.11.25*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 551 750	0,26	
LIECHTENSTEINISCHE LANDESBANK AG-REG-S 0.12500% 19-28.05.26*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 010 000	0,33	
LIMECO-REG-S 0.37500% 18-25.09.26*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 000 000	0,17	
LONZA SWISS FINANCE AG 1.25000% 15-22.09.23*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 036 000	0,17	795 000
LONZA SWISS FINANCE AG 0.70000% 17-12.07.24*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 023 500	0,17	1 000 000
LUGANO, CITY OF 0.62500% 15-01.09.25*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 042 500	0,17	
LUGANO, CITY OF 0.87500% 14-09.12.24*	CHF 1 000 000		1 000 000				
LUGANO, CITY OF-REG-S 0.25000% 17-20.12.27*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 026 000	0,17	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.41000% 19-31.01.29*	CHF 600 000			600 000	623 700	0,10	
LUZERNER KANTONSSPITAL-REG-S 0.62500% 18-25.09.28*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 046 000	0,17	
MOBIMO HOLDING AG 1.87500% 14-16.09.24*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 069 000	0,18	200 000
MOBIMO HOLDING AG-REG-S 0.25000% 20-23.03.28*	CHF 1 000 000	4 200 000	2 200 000	2 000 000	1 957 000	0,32	
NANT DE DRANCE SA 1.75000% 14-18.07.24*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 049 000	0,17	
NANT DE DRANCE SA 2.37500% 13-15.02.28*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 108 500	0,18	
NANT DE DRANCE SA 2.00000% 16-02.02.26*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 070 000	0,18	
NEUBURG, CANTON OF 1.25000% 12-24.09.27*	CHF 1 000 000		1 000 000				
NEUBURG, CANTON OF-REG-S 0.75000% 18-28.11.33*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 188 000	0,36	
NIDWALDNER KANTONALBANK 0.20000% 18-28.03.25*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 019 500	0,17	
NOVARTIS AG 0.25000% 15-13.05.25*	CHF 1 000 000		1 000 000				
NOVARTIS AG 0.62500% 15-13.11.29*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 063 000	0,18	
NOVARTIS AG 1.05000% 15-11.05.35*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 135 000	0,19	
OC OERLIKON CORP AG 2.62500% 14-17.06.24*	CHF 500 000			500 000	524 250	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.87500% 10-15.09.31*	CHF 3 000 000			3 000 000	3 636 000	0,60	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 12-21.01.28*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 256 200	0,37	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.37500% 12-13.08.27*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 222 600	0,37	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.12500% 12-16.11.23*	CHF 2 400 000			2 400 000	2 518 560	0,42	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.62500% 13-03.07.30*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 340 800	0,39	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.75000% 13-15.07.25*	CHF 500 000			500 000	551 000	0,09	495 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 13-16.01.23*	CHF 1 050 000			1 050 000	1 098 195	0,18	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.00000% 14-10.05.22*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 024 700	0,17	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.50000% 14-15.12.25*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 191 800	0,36	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.00000% 14-21.03.23*	CHF 3 050 000			3 050 000	3 162 545	0,52	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 15-25.04.33*	CHF 5 000 000		2 000 000	3 000 000	3 240 000	0,54	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 15-25.01.34*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 081 600	0,18	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.87500% 15-25.06.37*	CHF 2 500 000			2 500 000	2 841 000	0,47	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 1.00000% 15-12.05.32*	CHF 4 000 000		1 000 000	3 000 000	3 363 600	0,56	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.62500% 15-16.05.31*	CHF 500 000			500 000	537 000	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 15-15.10.25*	CHF 4 000 000			4 000 000	4 141 600	0,69	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 15-15.06.29*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 583 550	0,26	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.75000% 15-28.11.34*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 650 150	0,27	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.50000% 16-05.10.35*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 137 200	0,35	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-15.12.27*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 048 600	0,34	385 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 16-08.07.39*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 119 800	0,35	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-15.07.31*	CHF 2 500 000			2 500 000	2 546 750	0,42	600 000
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.37500% 16-15.06.46*	CHF 500 000			500 000	541 800	0,09	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.12500% 16-23.09.32*	CHF 500 000			500 000	507 850	0,08	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-18.01.27*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 065 000	0,34	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-27.04.26*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 061 200	0,34	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 18-17.11.25*	CHF 4 000 000			4 000 000	4 117 600	0,68	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-25.01.44*	CHF 1 500 000	1 500 000		1 500 000	1 661 250	0,28	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.50000% 19-25.01.44*	CHF 1 500 000	1 500 000	1 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.62500% 11-31.10.24*	CHF 700 000			700 000	758 030	0,13	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.37500% 12-19.03.27*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 106 800	0,18	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.62500% 12-17.04.28*	CHF 3 000 000			3 000 000	3 417 000	0,57	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.50000% 12-21.05.29*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 285 600	0,38	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.25000% 12-17.07.24*	CHF 500 000			500 000	531 750	0,09	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.00000% 12-13.02.23*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 071 200	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.87500% 12-20.06.22*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 024 300	0,17	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.37500% 13-05.11.27*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 228 800	0,37	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.37500% 13-12.12.22*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 083 800	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.62500% 14-17.06.26*	CHF 1 900 000			1 900 000	2 111 090	0,35	695 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.12500% 14-28.04.23*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 083 800	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 1.00000% 14-22.09.28*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 190 400	0,36	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-12.02.30*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 069 500	0,18	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 15-14.02.25*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 064 000	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-16.07.29*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 134 400	0,35	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-12.03.24*	CHF 1 200 000			1 200 000	1 222 080	0,20	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL 0.37500% 15-30.08.23*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 048 800	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-17.07.24*	CHF 4 000 000			4 000 000	4 079 200	0,68	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.62500% 15-01.11.30*	CHF 1 000 000			1 000 000	1 071 600	0,18	1 000 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 15-25.02.26*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 046 600	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 15-20.09.30*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 117 000	0,35	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.60000% 16-11.12.35*	CHF 4 000 000		1 000 000	3 000 000	3 257 100	0,54	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 16-30.03.34*	CHF 2 500 000			2 500 000	2 664 000	0,44	250 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.05000% 16-06.11.26*	CHF 500 000			500 000	509 600	0,08	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.30000% 16-06.06.31*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 077 000	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.12500% 16-02.09.31*	CHF 1 500 000			1 500 000	1 527 750	0,25	100 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 17-21.09.27*	CHF 2 000 000			2 000 000	2 084 000	0,34	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 17-20.02.32*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 061 500	0,18	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.50000% 17-12.10.29*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 168 900	0,52	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.25000% 17-26.05.27*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 065 400	0,34	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.25000% 17-12.05.26*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 122 000	0,68	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.37500% 17-24.07.28*	CHF	4 500 000			4 500 000	4 696 200	0,78	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.50000% 18-24.11.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 109 600	0,35	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 18-16.04.25*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 086 000	0,68	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.55000% 19-29.01.31*	CHF	4 000 000		1 000 000	3 000 000	3 199 500	0,53	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.70000% 19-04.03.39*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 233 600	0,37	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.10000% 20-12.06.30*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 058 500	0,51	275 000
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.25000% 20-12.06.40*	CHF		800 000		800 000	829 920	0,14	
PSP SWISS PROPERTY AG 1.00000% 15-06.02.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 041 000	0,17	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.50000% 16-16.02.24*	CHF	500 000			500 000	507 750	0,08	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.70000% 19-08.02.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 034 500	0,17	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-SUB 3.87500% 11-21.12.21*	CHF	1 000 000		1 000 000				
REGIONALSPITAL EMMENTAL AG 1.62500% 14-17.04.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 037 500	0,17	5 000
ROCHE KAPITALMARKT AG 0.45000% 17-23.03.29*	CHF	400 000			400 000	418 800	0,07	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.25000% 18-24.09.25*	CHF	3 000 000		1 000 000	2 000 000	2 052 000	0,34	
SCHAFFHAUSER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 18-31.05.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 045 000	0,17	
SCHWYZER KANTONALBANK 0.62500% 15-02.07.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
SEE-SPITAL 1.25000% 18-03.07.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 042 500	0,17	80 000
SERVICES INDUSTRIELS DE GENEVE 1.25000% 15-30.06.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 074 000	0,34	
SGS SA 0.55000% 17-03.03.26*	CHF	500 000			500 000	510 250	0,08	
SGS SA 0.87500% 15-08.05.30*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 047 500	0,17	
SGS SA 1.75000% 14-27.02.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
SIKA AG-REG-S 1.12500% 18-12.07.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 061 400	0,18	740 000
SOLOTHURN, CANTON OF 0.20000% 16-15.12.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 038 000	0,17	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.40000% 19-11.10.34*	CHF	750 000			750 000	745 500	0,12	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-06.04.22*	CHF		1 500 000	500 000	1 000 000	1 010 000	0,17	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-06.04.22*	CHF		1 500 000	1 500 000				
SPITAL LIMMATTAL 0.55000% 15-15.05.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 011 500	0,17	
SPITAL MAENNEDORF AG-REG-S 0.95000% 18-12.12.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	998 000	0,17	
ST GALLEN, CITY OF 0.60000% 17-21.09.37*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 092 500	0,18	
ST GALLEN, CITY ON 1.62500% 11-10.11.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 099 000	0,18	
ST GALLER KANTONALBANK 0.62500% 17-23.01.32*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 062 500	0,18	
ST GALLER KANTONALBANK AG-REG-S 0.35000% 19-24.01.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 067 000	0,34	280 000
STRAUMANN HOLDING AG-REG-S 0.55000% 20-03.10.25*	CHF		500 000		500 000	508 750	0,08	
SULZER AG 0.37500% 16-11.07.22*	CHF	1 000 000		1 000 000				
SULZER AG 0.87500% 16-10.07.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 007 000	0,17	
SULZER AG-REG-S 1.30000% 18-06.07.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 020 500	0,17	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.82500% 17-11.05.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 020 000	0,17	200 000
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 045 500	0,17	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.37500% 19-30.09.31*	CHF	2 000 000		1 000 000	1 000 000	954 000	0,16	460 000
SWISS REINSURANCE CO LTD-REG-S 1.00000% 14-17.09.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
SWISSCOM AG 0.13000% 20-18.09.31*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 021 000	0,50	
SWISSCOM AG 0.37500% 16-31.03.28*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 553 250	0,26	
SWISSCOM AG 1.00000% 15-17.04.35*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 668 000	0,28	
SWISSCOM AG-REG-S 0.50000% 19-15.03.29*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 044 500	0,17	
SWISSGRID AG 0.62500% 15-25.02.30*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 061 500	0,18	
SWISSGRID AG-REG-S 0.05000% 19-30.06.50*	CHF	1 000 000			1 000 000	904 500	0,15	
SWISSGRID AG-REG-S 0.15000% 20-30.06.34*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 007 500	0,17	
SWITZERLAND 1.25000% 12-11.06.24*	CHF	10 500 000		4 500 000	6 000 000	6 459 000	1,07	
SWITZERLAND 1.25000% 12-27.06.37*	CHF	6 000 000			6 000 000	7 617 600	1,26	1 200 000
SWITZERLAND 1.25000% 14-28.05.26*	CHF	5 900 000			5 900 000	6 564 340	1,09	
SWITZERLAND 1.50000% 12-30.04.42*	CHF	4 700 000			4 700 000	6 598 330	1,09	
SWITZERLAND 1.50000% 13-24.07.25*	CHF	5 400 000			5 400 000	5 994 000	0,99	
SWITZERLAND 2.00000% 11-25.05.22*	CHF	2 000 000		2 000 000				
SWITZERLAND 2.00000% 14-25.06.64*	CHF	1 200 000			1 200 000	2 541 480	0,42	1 200 000
SWITZERLAND 2.25000% 11-22.06.31*	CHF	5 000 000			5 000 000	6 498 500	1,08	
SWITZERLAND 2.50000% 06-08.03.36*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 449 200	0,24	452 000
SWITZERLAND 3.25000% 07-27.06.27*	CHF	3 500 000			3 500 000	4 441 500	0,74	
SWITZERLAND 3.50000% 03-08.04.33*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 502 900	0,25	
SWITZERLAND 4.00000% 98-11.02.23*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 229 800	0,37	
SWITZERLAND 4.00000% 99-06.01.49*	CHF	1 000 000			1 000 000	2 276 600	0,38	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 498 500	0,91	2 889 336
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 16-30.05.58*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 692 000	0,45	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-24.05.55*	CHF	5 000 000			5 000 000	6 539 000	1,08	2 300 000
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 17-28.06.45*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 428 400	0,40	
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 18-27.06.32*	CHF	7 500 000			7 500 000	8 339 250	1,38	78 000
TESSIN, CANTON OF 0.40000% 16-27.06.44*	CHF	500 000			500 000	540 000	0,09	
TESSIN, CANTON OF 1.25000% 12-11.06.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 099 500	0,18	
TESSIN, CANTON OF 2.12500% 10-24.11.34*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 296 500	0,21	
THURGAU, CANTON OF 0.37500% 15-12.06.25*	CHF	700 000			700 000	726 950	0,12	
THURGAUER KANTONALBANK 0.37500% 15-31.03.25*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 028 000	0,17	
THURGAUER KANTONALBANK 0.37500% 17-08.02.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 037 500	0,17	
TRANSPORTS PUBLICS GENEVOIS 0.90000% 15-21.05.35*	CHF	800 000			800 000	882 000	0,15	
URNER KANTONALBANK 0.12500% 16-27.11.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 017 000	0,17	
VALIANT BANK AG 0.12500% 19-04.12.34*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 005 000	0,17	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.12500% 18-23.04.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
VAUD, CANTON OF 2.00000% 13-24.10.33*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 281 500	0,21	
VIFOR PHARMA AG-REG-S 0.75000% 18-13.09.22*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 010 000	0,17	
VP BANK AG 0.87500% 15-07.10.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 058 000	0,34	
WALLISER KANTONALBANK 0.40000% 15-15.09.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
WALLISER KANTONALBANK 0.20000% 16-19.08.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
WALLISER KANTONALBANK 0.20000% 17-02.02.26*	CHF	1 000 000		1 000 000				
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 19-01.02.27*	CHF	2 000 000		1 000 000	1 000 000	1 027 500	0,17	1 000 000
WINTERTHUR, CITY OF 1.87500% 12-20.04.37*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 292 500	0,21	
WINTERTHUR, CITY OF 2.25000% 14-10.02.39*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 395 500	0,23	
WINTERTHUR, CITY OF 0.30000% 15-10.12.27*	CHF	1 000 000		1 000 000				
WINTERTHUR, CITY OF-REG-S 0.10000% 19-20.03.28*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 016 500	0,17	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.75000% 15-28.10.30*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 156 000	0,36	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.12500% 16-13.05.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 017 500	0,17	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.02000% 16-16.08.27*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 020 000	0,33	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.05000% 16-23.11.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 014 000	0,17	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.25000% 17-27.01.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 025 000	0,17	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 18-25.01.28*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 061 000	0,34	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 19-25.01.27*	CHF	4 000 000		2 000 000	2 000 000	2 041 000	0,34	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 19-06.06.29*	CHF	750 000			750 000	763 125	0,13	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.050000% 20-05.02.31*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 512 750	0,25	
ZUERICH, CANTON OF 1.000000% 12-03.12.25*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 614 000	0,27	
ZUERICH, CANTON OF 1.250000% 14-07.03.24*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 062 500	0,18	
ZUERICH, CANTON OF-REG-S 0.100000% 20-23.06.45*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 560 000	0,26	
ZUERICH, CITY OF 0.400000% 16-21.11.46*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 101 000	0,18	
ZUERICH, CITY OF 0.700000% 17-24.11.39*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 125 000	0,19	
ZUERICH, CITY OF 1.000000% 12-05.12.23*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 254 000	0,21	
ZUG ESTATES HOLDING AG 0.700000% 17-17.02.22*	CHF	600 000			600 000	602 580	0,10	445 000
ZUG ESTATES HOLDING AG-REG-S 0.100000% 19-02.10.25*	CHF	1 425 000			1 425 000	1 390 800	0,23	
ZUGER KANTONALBANK 0.500000% 15-03.03.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 042 000	0,17	
ZUGER KANTONALBANK 1.500000% 12-05.06.37*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 842 000	0,30	
ZUGER KANTONALBANK AG 0.375000% 16-15.12.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 033 560	0,17	
ZURICH INSURANCE CO 1.500000% 14-22.07.26*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 168 000	0,36	
ZURICH INSURANCE CO-REG-S 0.750000% 19-22.10.27*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 044 000	0,17	110 000
ZURICH, CITY OF-REG-S 0.250000% 19-26.05.39*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 080 000	0,34	
Total CHF						471 645 250	78,08	

Total Anleihen, fester Zins **471 645 250** **78,08**

Anleihen, Nullcoupon

CHF								
BALOISE HOLDING-REG-S 0.000000% 19-25.09.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 950 060	0,32	290 000
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.000000% 19-16.07.29*	CHF	2 500 000		1 500 000	1 000 000	1 008 500	0,17	
GENEVA, CANTON OF 0.000000% 19-23.09.59*	CHF	1 500 000		1 500 000				
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.000000% 19-23.09.59*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 391 250	0,23	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.000000% 19-16.10.29*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 003 000	0,33	210 000
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.000000% 20-06.09.28*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 016 000	0,33	
KANTONSSPITAL WINTERTHUR-REG-S 0.000000% 19-30.09.31*	CHF	1 315 000			1 315 000	1 291 330	0,21	
LUCERNE, CANTON OF 0.000000% 20-23.07.30*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 046 000	0,34	
NIDWALDNER KANTONALBANK-REG-S 0.000000% 19-05.11.29*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 501 500	0,25	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.000000% 19-26.08.49*	CHF	500 000			500 000	496 250	0,08	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.000000% 19-06.04.27*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 033 400	0,34	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.000000% 20-25.02.28*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 043 200	0,50	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.000000% 20-10.05.45*	CHF		4 000 000		4 000 000	3 967 600	0,66	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.000000% 16-27.01.27*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 062 000	0,67	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALBANKEN 0.000000% 19-10.09.37*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 970 450	0,49	
PSP SWISS PROPERTY AG 0.000000% 16-01.09.23*	CHF	1 000 000			1 000 000	999 000	0,17	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.000000% 20-15.07.22*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 010 500	0,50	
RHAETISCHE BAHN STAMM 0.000000% 16-01.09.31*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 012 000	0,17	
SONOVA HOLDING AG-REG-S 0.000000% 19-11.10.29*	CHF	1 500 000		500 000	1 000 000	975 500	0,16	
SWISS CONFEDERATION GOVERNMENT BD-REG-S 0.000000% 20-26.06.34*	CHF		3 000 000	3 000 000				
SWITZERLAND-REG-S 0.000000% 16-22.06.29*	CHF	8 000 000			8 000 000	8 392 800	1,39	
SWITZERLAND-REG-S 0.000000% 19-26.06.34*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 158 700	0,52	
SWITZERLAND-REG-S 0.000000% 19-24.07.39*	CHF		3 000 000		3 000 000	3 177 300	0,53	420 000
SWITZERLAND-REG-S 0.000000% 20-24.07.39*	CHF			3 000 000				
VALIANT BANK AG-REG-S 0.000000% 19-31.07.29*	CHF	1 100 000			1 100 000	1 101 100	0,18	45 000
VALIANT BANK AG-REG-S 0.000000% 19-31.10.25*	CHF		3 000 000	3 000 000				
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.000000% 20-14.02.29*	CHF		1 000 000		1 000 000	1 002 000	0,17	
ZUERICH, CANTON OF 0.000000% 18-27.06.25*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 048 000	0,34	
ZUERICH, CANTON OF-REG-S 0.000000% 20-23.06.28*	CHF		1 500 000		1 500 000	1 539 000	0,25	
Total CHF						56 196 440	9,30	

Total Anleihen, Nullcoupon **56 196 440** **9,30**

Anleihen, variabler Zins

CHF								
SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-25.09.48*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 051 500	0,16	575 000
Total CHF						1 051 500	0,16	

Total Anleihen, variabler Zins **1 051 500** **0,16**

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden **600 499 842** **99,40**

Total Wertschriften **600 499 842** **99,40**
(davon ausgeliehen 36 218 713 6,00)

Bankguthaben auf Sicht						3 505 628	0,58	
Derivative Finanzinstrumente						-2 264 961	-0,37	
Sonstige Vermögenswerte						2 326 344	0,39	
Gesamtfondsvermögen						604 066 853	100,00	

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-6 118 586		
Andere Verbindlichkeiten						-133 419		
Nettofondsvermögen						597 814 848		

Bewertungskategorie

	Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	600 499 842	99,40
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	-2 264 961	-0,37
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	598 234 881	99,03

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.25000% 14-10.09.29**	3 000 000	CHF	3 000 000	-457 407	-0.08
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 14-10.09.29	3 000 000	CHF			
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.42750% 14-11.09.34**	2 500 000	CHF	2 500 000	-593 949	-0.10
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP RECEIVER 6ML 14-11.09.34	2 500 000	CHF			
BKB/INTEREST RATE SWAP PAY 0.31000% 17-07.08.25**	5 000 000	CHF	5 000 000	-232 839	-0.04
BKB/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 17-07.08.25	5 000 000	CHF			
BASLER/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.54250% 17-12.06.25**	5 000 000	CHF	5 000 000	-293 190	-0.05
BASLER/INTEREST RATE SWAP RECEIVER 6ML 17-12.06.25	5 000 000	CHF			
BKB/INTEREST RATE SWAP PAY 1.11750% 17-12.06.24**	4 000 000	CHF	4 000 000	-287 398	-0.05
BKB/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 17-12.06.24	4 000 000	CHF			
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.23250% 17-13.12.27**	5 000 000	CHF	5 000 000	-282 044	-0.04
ZUERCHER/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 17-13.12.27	5 000 000	CHF			
UBS/OVERNIGHT INDEX SWAP PAYER -0.25000% 20-14.08.50**	5 000 000	CHF	5 000 000	-95 712	-0.01
UBS/OVERNIGHT INDEX SWAP REC 20-14.08.50	5 000 000	CHF			
			29 500 000	-2 242 539	-0.37

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
GBP	800 000	CHF	927 486	15.10.2020	-22 422	0.00
					-22 422	0.00

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
UBS/OVERNIGHT INDEX SWAP PAYER -0.25000% 20-14.08.50	CHF	5 000 000
UBS/OVERNIGHT INDEX SWAP REC 20-14.08.50	CHF	5 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
GBP	100 000	CHF	126 290	12.03.2020
GBP	100 000	CHF	126 784	12.03.2020
GBP	200 000	CHF	241 018	14.04.2020
GBP	50 000	CHF	57 700	14.04.2020
GBP	250 000	CHF	300 498	15.05.2020
GBP	250 000	CHF	297 436	15.06.2020
CHF	241 137	GBP	200 000	15.06.2020
GBP	200 000	CHF	240 582	15.09.2020
GBP	400 000	CHF	475 010	15.09.2020
GBP	150 000	CHF	179 103	15.09.2020
GBP	800 000	CHF	927 486	15.10.2020

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	–	–
Total engagement- reduzierende Positionen	28 244 237,14	4,72%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen
keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,0725% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,2625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,20% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,30% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich
«soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Be-
rechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER)
von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management
Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen
Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen
Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsver-
mögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv
in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,08%
Klasse I-A2:	0,27%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurs

GBP 1 = CHF 1.187760

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		511 649 427.35	408 249 262.25	387 274 447.33
Klasse I-A1	CH0108009199			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 682.94	1 668.53	1 467.95
Anzahl Anteile im Umlauf		304 020,6980	244 676,5380	263 819,0400

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	3.1%	16.7%	2.5%
Benchmark/Index: SPI 20 Total Return®	CHF	3.3%	16.9%	2.8%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Der Anlagefonds investiert passiv in den Referenzindex SPI 20 Total Return®. Während der Berichtsperiode betrug der Two-Way Turnover der Benchmark SPI 20 Total Return® 5.62%. Insgesamt verzeichneten wir eine Neuaufnahme, eine Streichung sowie 20 andere Veränderungen (Anzahl ausstehender Aktien, Streubesitzfaktoren), welche einen One-Way Turnover von 1.60%, 0.70%, sowie 2.54% verzeichneten.

Diese Zahlen können wie folgt aufgeteilt werden:

Die Umschichtung, welche am 20. Dezember 2019 stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 0.16% mit drei signifikanten Veränderungen (0.10%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen. Die Umschichtung, welche am 20. März 2020 stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 0.45% mit fünf signifikanten Veränderungen (0.39%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen. Die Umschichtung, welche am 19. Juni 2020 stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 1.30% mit sechs signifikanten Veränderungen (0.72%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen. Die Umschichtung, welche am 18. September 2020 stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 3.70% mit einer Neuaufnahme (1,60%: PARTNERS GROUP N am 18.09.2020), einer Streichung (-0.70%: ADECCO N am 18.9.2020) und sechs weiteren Veränderungen (1.33%).

Die grössten Titelgewichtserhöhungen auf Tagesbasis lagen bei:

PARTNERS GROUP N (1.60%; 18.09.2020)
NOVARTIS N (0.34%; 19.06.2020)
ABB LTD N (0.25%; 18.09.2020)
SGS N (0.22%; 20.03.2020)
SIKA N (0.22%; 19.06.2020)

Die grössten Titelgewichtsreduzierungen auf Tagesbasis lagen bei:

NESTLE N (-0.88%; 18.09.2020)
ADECCO N (-0.70%; 18.09.2020)
NESTLE N (-0.23%; 19.06.2020)
CS GROUP N (-0.19%; 18.09.2020)
ROCHE GS (-0.17%; 19.06.2020)

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	98,72
Total	98,72

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	1 922 011.82	1 162 507.84
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	507 692 089.99	406 816 463.47
Derivative Finanzinstrumente	-166 100.00	13 800.00
Sonstige Vermögenswerte	4 855 959.59	1 287 683.91
Gesamtfondsvermögen	514 303 961.40	409 280 455.22
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-2 396 385.39	-819 029.34
Andere Verbindlichkeiten	-258 148.66	-212 163.63
Nettofondsvermögen	511 649 427.35	408 249 262.25

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Negativzinsen	-8 616.34	-5 225.76
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	13 270 909.73	10 536 239.58
– aus Gratisaktien	0.00	6 978.78
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	604 683.61	
Erträge der Effektenleihe	20 097.35	121.29
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	657 878.80	492 071.71
Total Ertrag	14 544 953.15	11 030 185.60
Aufwand		
Passivzinsen	15.99 ²	1 831.46 ¹
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-926 467.18	-741 071.50
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-36 096.06	-28 872.97
Sonstige Aufwendungen	-96.94	-1 148.19
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-673 869.63	-667 201.01
Total Aufwand	-1 636 513.82	-1 436 462.21
Nettoertrag	12 908 439.33	9 593 723.39
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	5 523 435.01	8 510 865.84
Realisierter Erfolg	18 431 874.34	18 104 589.23
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-5 276 132.82	40 607 422.64
Gesamterfolg	13 155 741.52	58 712 011.87

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	12 908 439.33	9 593 723.39
Vortrag des Vorjahres	65 024.93	13 686.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	12 973 464.26	9 607 409.91
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-12 920 879.67	-9 542 384.98
Vortrag auf neue Rechnung	52 584.59	65 024.93

¹ Die Passivzinsen per 30.9.2019 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 2 347.91

² Die Passivzinsen per 30.9.2020 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 511.24

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	408 249 262.25	387 274 447.33
Ordentliche Jahresausschüttung	-11 083 315.93	-9 005 337.67
Saldo aus dem Anteilverkehr	101 327 739.51	-28 731 859.28
Gesamterfolg	13 155 741.52	58 712 011.87
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	511 649 427.35	408 249 262.25

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	244 676,5380	263 819,0400
Ausgegebene Anteile	82 688,1800	47 816,5680
Zurückgenommene Anteile	-23 344,0200	-66 959,0700
Bestand Ende Berichtsperiode	304 020,6980	244 676,5380
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	59 344,1600	-19 142,5020

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	42.6729
Brutto	CHF	42.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-14.8750
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	27.6250

Inventar des Fondsvermögens

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Schweiz								
SWATCH GROUP CHF2.25(BR)*	CHF	10 110	3 373	1 073	12 410	2 666 909	0,52	3 028
SWISS RE AG CHF0.10*	CHF	103 178	32 551	10 614	125 115	8 542 852	1,66	
Total Schweiz						11 209 761	2,18	
Total Inhaberaktien						11 209 761	2,18	
Weitere Aktien								
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV*	CHF	245 970	80 014	21 863	304 121	95 843 733	18,64	
Total Schweiz						95 843 733	18,64	
Total Weitere Aktien						95 843 733	18,64	
Namensaktien								
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF	636 807	259 713	61 356	835 164	19 584 596	3,81	
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	57 046	18 670	75 716				
ALCON AG CHF0.04*	CHF	171 041	54 973	14 382	211 632	11 068 354	2,15	
CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)*	CHF	847 942	324 291	228 808	943 425	8 721 021	1,70	
GEBERIT CHF0.10(REGD)*	CHF	12 981	4 402	1 432	15 951	8 706 056	1,69	
GIVAUDAN AG CHF10*	CHF	2 786	871	223	3 434	13 632 980	2,65	
LAFARGEHOLCIM LTD CHF2 (REGD)*	CHF	177 444	56 281	14 339	219 386	9 212 018	1,79	
LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*	CHF	26 071	8 176	2 103	32 144	18 277 078	3,55	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	1 044 352	339 097	132 814	1 250 635	136 744 431	26,59	
NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)*	CHF	841 155	292 631	67 356	1 066 430	85 218 421	16,57	
PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*	CHF		9 799		9 799	8 305 632	1,61	
RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A**	CHF	182 602	57 113	14 498	225 217	13 895 889	2,70	
SGS LTD CHF1 (REGD)*	CHF	1 799	1 044	196	2 647	6 535 443	1,27	
SIKA AG CHF0.01 (REG)*	CHF	44 340	20 544	3 672	61 212	13 852 276	2,69	56 167
SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)*	CHF	11 734	3 328	1 284	13 778	4 801 633	0,93	
SWISSCOM AG CHF1 (REGD)*	CHF	8 876	2 863	769	10 970	5 359 942	1,04	9 872
UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*	CHF	1 270 191	393 969	118 313	1 545 847	15 922 224	3,10	
ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*	CHF	52 365	16 800	4 305	64 860	20 800 602	4,05	
Total Schweiz						400 638 596	77,91	
Total Namensaktien						400 638 596	77,91	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						507 692 090	98,72	
Total Wertschriften						507 692 090	98,72	
(davon ausgeliehen)						18 184 769	3,54	
Bankguthaben auf Sicht						1 922 012	0,37	
Derivative Finanzinstrumente						-166 100	-0,03	
Sonstige Vermögenswerte						4 855 959	0,94	
Gesamtfondsvermögen						514 303 961	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-2 396 385		
Andere Verbindlichkeiten						-258 149		
Nettofondsvermögen						511 649 427		
Bewertungskategorie						Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens³	
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						507 525 990	98,69	
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						-	-	
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten						-	-	
Total						507 525 990	98,69	

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.20*	55	CHF	5 601 200	-166 100	-0.03
			5 601 200	-166 100	-0.03

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 5 601 200

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.19	CHF	3	23
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.03.20	CHF	38	38
SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.12.20	CHF	56	1
SWISS MARKET INDEX FUTURE 19.06.20	CHF	79	79
SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.09.20	CHF	64	64

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	5 601 200,00	1,09%
Total engagement- reduzierende Positionen	–	–

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
Klasse I-A1: 0,1925% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
Klasse I-A1: 0,30% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission:
0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission gemäss
Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1: 0,20%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2020	30.9.2019	30.9.2018
Nettofondsvermögen in CHF		1 815 724 362.08	1 776 939 927.10	1 671 379 573.24
Klasse I-A1	CH0219870430			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		866.94	880.49	892.92
Anzahl Anteile im Umlauf		2 054 435,3770	1 970 766,6310	1 811 619,0490
Klasse I-A2	CH0219870455			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		864.71	877.77	890.26
Anzahl Anteile im Umlauf		35 495,0000	22 508,0000	30 696,0000
Klasse I-A2 Cap	CH0407409843			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		996.65	996.63	995.30
Anzahl Anteile im Umlauf		3 980,0000	22 025,0000	26 555,0000

Performance

	Währung	2019/2020	2018/2019	2017/2018
Klasse I-A1	CHF	1.0%	1.3%	-1.8%
Klasse I-A2	CHF	0.8%	1.0%	-2.0%
Klasse I-A2 Cap	CHF	0.8%	1.0%	-0.5%
Referenzindex:				
Barclays Global Aggregate Corporates 1-3 years in CHF (CHF hedged)	CHF	1.3%	1.4%	-1.6%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Während zu Beginn der Berichtsperiode das Umfeld für kurzlaufende Unternehmensanleihen noch relativ konstruktiv war und sich die Risikoprämien graduell einengten, kam dieser Trend mit dem Ausbruch der Corona-Krise zu einem jähen Ende. Die Kreditspannen weiteten sich im März in Rekordzeit auf ein Mehrjahreshoch aus. Die Interventionen der Notenbanken und die Hilfspakete der Regierungen führten anschliessend zu einer fast ebenso raschen Erholung. In Kombination mit den fallenden Zinsen führte dies zu einer deutlich positiven absoluten Performance. Relativ lag die Anlagefonds durch die defensivere Positionierung leicht hinter Benchmark.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten	35,30
Grossbritannien	8,58
Deutschland	7,71
Frankreich	6,17
Japan	4,88
Kanada	4,85
Schweden	4,25
Australien	3,55
China	3,32
Schweiz	3,01
Übrige	13,50
Total	95,12

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2020	30.9.2019
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	85 264 213.07	46 101 205.81
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 737 007 372.72	1 733 476 084.83
Derivative Finanzinstrumente	-8 236 737.05	-8 067 746.88
Sonstige Vermögenswerte	12 091 027.01	14 049 256.54
Gesamtfondsvermögen	1 826 125 875.75	1 785 558 800.30
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-9 668 999.64	-7 915 582.95
Andere Verbindlichkeiten	-732 514.03	-703 290.25
Nettofondsvermögen	1 815 724 362.08	1 776 939 927.10

Erfolgsrechnung

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	115 809.97	99 323.24
Negativzinsen	-133 131.64	-51 814.38
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	38 491 696.69	41 371 531.90
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	1 183 329.60	2 954 194.39
Erträge der Effektenleihe	154 896.22	244 786.44
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	4 679 025.91	5 901 073.75
Total Ertrag	44 491 626.75	50 519 095.34
Aufwand		
Passivzinsen	-13 568.09	-14 169.85
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-2 477 876.42	-2 306 364.34
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-85 493.62	-114 314.67
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2 Cap	-34 197.22	-95 182.34
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-132 824.46	-125 605.80
Sonstige Aufwendungen	-2 960.87	-1 226.02
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-3 740 190.74	-2 915 638.88
Total Aufwand	-6 487 111.42	-5 572 501.90
Nettoertrag	38 004 515.33	44 946 593.44
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	37 158 063.88	-22 266 615.48
Realisierter Erfolg	75 162 579.21	22 679 977.96
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-56 734 963.03	965 942.38
Gesamterfolg	18 427 616.18	23 645 920.34

Verwendung des Erfolges

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	38 004 515.33	44 946 593.44
Vortrag des Vorjahres	527 464.13	875 589.66
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	38 531 979.46	45 822 183.10
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg	-73 896.17	-502 309.77
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-37 565 504.29	-44 792 409.20
Vortrag auf neue Rechnung	892 579.00	527 464.13

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 776 939 927.10	1 671 379 573.24
Ordentliche Jahresausschüttung	-45 131 406.05	-40 863 416.15
Abgeführte Verrechnungssteuer	-79 662.58	-224 995.02
Saldo aus dem Anteilverkehr	65 567 887.43	123 002 844.69
Gesamterfolg	18 427 616.18	23 645 920.34
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 815 724 362.08	1 776 939 927.10

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2019-30.9.2020	1.10.2018-30.9.2019
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 970 766,6310	1 811 619,0490
Ausgegebene Anteile	420 712,8830	487 491,4260
Zurückgenommene Anteile	-337 044,1370	-328 343,8440
Bestand Ende Berichtsperiode	2 054 435,3770	1 970 766,6310
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	83 668,7460	159 147,5820
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	22 508,0000	30 696,0000
Ausgegebene Anteile	21 847,0000	32 580,0000
Zurückgenommene Anteile	-8 860,0000	-40 768,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	35 495,0000	22 508,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	12 987,0000	-8 188,0000
Klasse I-A2 Cap		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	22 025,0000	26 555,0000
Ausgegebene Anteile	6 170,3400	1 770,0000
Zurückgenommene Anteile	-24 215,3400	-6 300,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	3 980,0000	22 025,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-18 045,0000	-4 530,0000

Ausschüttung für 2019/2020

Klasse I-A1

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	18.4336
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	18.0000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-6.3000
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	11.7000
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	18.0000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 19.1.2021)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	16.5450
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	16.5000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-5.7750
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	10.7250
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 21.1.2021)	CHF	16.5000

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Klasse I-A2 Cap

Thesaurierung per 19.1.2021

Brutto Thesaurierungsbetrag	CHF	18.5668
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹	CHF	-6.4984
Thesaurierung netto pro Anteil	CHF	12.0684

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber gem. Kreisschreiben Nr. 24 Ziffer 2.3.4. ESTV in Verbindung mit Art. 34 Abs. 1 VStV.

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Notes, fester Zins							
CHF							
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-SUB 4.75000% 12-24.10.22*	CHF	3 000 000		3 000 000	3 196 500	0,18	
Total CHF					3 196 500	0,18	
EUR							
ABBOTT IRELAND FINANCING DAC-REG-S 0.10000% 19-19.11.24*	EUR	7 700 000		7 700 000	8 340 563	0,46	400 000
ABBVIE INC-144A 0.50000% 20-01.06.21*	EUR	5 400 000		5 400 000	5 835 263	0,32	200 000
AIRBUS SE-REG-S 1.62500% 20-07.04.25*	EUR	3 300 000	3 300 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 0.35000% 19-26.08.22*	EUR	2 900 000		2 900 000	3 145 506	0,17	610 000
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.60000% 20-20.04.22*	EUR	2 600 000		2 600 000	2 870 177	0,16	
BAIC INALFA HK INVESTMENT CO LTD-REG-S 1.90000% 15-02.11.20*	EUR	3 000 000		3 000 000	3 237 167	0,18	
BANK OF CHINA LUXEMBOURG-REG-S 0.12500% 20-16.01.23*	EUR	13 200 000		13 200 000	14 075 601	0,77	280 000
BAYER AG-REG-S 0.37500% 20-06.07.24*	EUR	6 500 000		6 500 000	7 061 043	0,39	4 500 000
DELL BANK INTERNATIONAL DAC-REG-S 0.62500% 19-17.10.22*	EUR	4 800 000		4 800 000	5 166 470	0,28	500 000
DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 0.12500% 20-15.10.22*	EUR	5 426 000	5 426 000				
EATON CAPITAL UNLIMITED CO-REG-S 0.69700% 19-14.05.25*	EUR	8 000 000		8 000 000	8 788 616	0,48	916 000
EXXON MOBIL CORP 0.14200% 20-26.06.24*	EUR	15 600 000	3 400 000	12 200 000	13 193 520	0,72	12 200 000
FISERV INC 0.37500% 19-01.07.23*	EUR	1 500 000	1 500 000				
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.37500% 19-07.03.23*	EUR	3 800 000		3 800 000	4 135 372	0,23	3 800 000
mitsubishi UFJ FINANCIAL GRP INC-REG-S 0.97800% 20-09.06.24*	EUR	3 700 000		3 700 000	4 099 591	0,22	1 000 000
MTU AERO ENGINES AG-REG-S 3.00000% 20-01.07.25*	EUR	2 900 000	2 900 000				
NASDAQ OMX GROUP INC 3.87500% 13-07.06.21*	EUR	3 000 000	3 000 000				
NISSAN MORTOR CO LTD-REG-S 1.94000% 20-15.09.23*	EUR	800 000	800 000				
PEPSICO INC 0.25000% 20-06.05.24*	EUR	6 600 000		6 600 000	7 198 274	0,39	6 600 000
UPJOHN FINANCE BV-REG-S 0.81600% 20-23.06.22*	EUR	1 600 000	1 600 000				
UPJOHN FINANCE BV-REG-S 1.02300% 20-23.06.24*	EUR	2 200 000	2 200 000				
ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 1.25000% 19-23.10.23*	EUR	2 100 000	2 100 000				
Total EUR					87 147 164	4,77	
GBP							
AXA SA-SUB 7.12500% 00-15.12.20*	GBP	2 700 000	300 000	3 000 000	3 609 631	0,20	
DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 1.25000% 19-05.09.22*	GBP	5 900 000		5 900 000	7 022 851	0,38	
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV-REG-S 1.62500% 19-30.11.22*	GBP	4 000 000		4 000 000	4 796 403	0,26	
Total GBP					15 428 885	0,84	
USD							
ABN AMRO BANK NV-144A 3.40000% 18-27.08.21*	USD	2 900 000	500 000	3 400 000	3 209 200	0,18	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.12500% 15-28.11.21*	USD	9 368 000		9 368 000	8 818 923	0,48	
AMAZON.COM INC 2.50000% 12-29.11.22*	USD	4 000 000	4 000 000				
AMERICAN EXPRESS CO 2.20000% 17-30.10.20*	USD	7 500 000	7 500 000				
AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 19-30.07.24*	USD	6 500 000		6 500 000	6 356 038	0,35	5 261 000
AMERICAN TOWER CORP 3.30000% 16-15.02.21*	USD	4 996 000	4 996 000				
AMERIPRISE FINANCIAL INC 4.00000% 13-15.10.23*	USD	5 000 000		5 000 000	5 075 763	0,28	
AMGEN INC 1.90000% 20-21.02.25*	USD	4 800 000	4 800 000		4 800 000	4 616 393	0,25
AMGEN INC 2.20000% 17-11.05.20*	USD	5 000 000	5 000 000				
ANALOG DEVICES INC 2.50000% 16-05.12.21*	USD	3 550 000		3 550 000	3 323 345	0,18	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 17-11.09.24*	USD	4 000 000	4 000 000		4 000 000	3 951 529	0,22
APPLE INC 0.75000% 20-11.05.23*	USD	4 500 000	4 500 000		4 500 000	4 176 549	0,23
APPLE INC 1.12500% 20-11.05.25*	USD	6 500 000	6 500 000		6 111 330	0,33	1 800 000
APPLE INC 1.55000% 16-04.08.21*	USD	3 000 000	500 000	3 500 000			
BAIDU INC 3.50000% 12-28.11.22*	USD	3 000 000		3 000 000	2 884 588	0,16	
BAKER HUGHES A GE CO/CO-OBLIGATOR 2.77300% 18-15.12.22*	USD	4 000 000		4 000 000	3 842 680	0,21	
BANK OF AMERICA CORP 5.87500% 10-05.01.21*	USD	5 000 000		5 000 000	4 660 789	0,26	
BANK OF NOVA SCOTIA 2.15000% 17-14.07.20*	USD	8 000 000	8 000 000				
BANK OF NOVA SCOTIA 2.50000% 18-08.01.21*	USD	5 000 000	500 000	5 500 000	5 083 858	0,28	
BANK OF NOVA SCOTIA 1.62500% 20-01.05.23*	USD	9 700 000	9 700 000		9 144 350	0,50	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-REG-S 3.75000% 18-20.07.23*	USD	3 800 000	4 200 000	8 000 000	7 973 019	0,44	
BARCLAYS PLC 3.68400% 17-10.01.23*	USD	4 000 000	4 000 000		4 000 000	3 788 570	0,21
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 1.66800% 20-25.03.26*	USD	3 800 000	3 800 000				
BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.50000% 18-25.06.21*	USD	4 000 000		4 000 000	3 748 739	0,21	
BEST BUY CO INC 5.50000% 11-15.03.21*	USD	6 063 000		6 063 000	5 627 438	0,31	
BIOGEN INC 3.62500% 15-15.09.22*	USD	7 476 000		7 476 000	7 273 655	0,40	
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 3.50000% 19-25.06.24*	USD	5 050 000		5 050 000	4 883 624	0,27	
BOC AVIATION LTD-REG-S 2.75000% 17-18.09.22*	USD	7 000 000	200 000	7 200 000			
BOEING CO 4.50800% 20-01.05.23*	USD	6 500 000	6 500 000				
BP CAPITAL MARKETS PLC 4.50000% 18-01.10.20*	USD	3 000 000		3 000 000	2 756 250	0,15	
BP CAPITAL MARKETS PLC 2.75000% 18-10.05.23*	USD	6 078 000		6 078 000	5 891 680	0,32	
BP CAPITAL MARKETS PLC 2.11200% 18-16.09.21*	USD	2 000 000		2 000 000	1 865 952	0,10	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.60000% 20-16.05.22*	USD	4 500 000		4 500 000	4 289 207	0,23	
BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 2.20000% 18-15.01.21*	USD	4 000 000	4 000 000				
BROADCOM INC-REG-S 2.25000% 20-15.11.23*	USD	5 500 000	5 500 000				
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 3.00000% 13-15.03.23*	USD	3 000 000		3 000 000	2 904 279	0,16	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 2.10000% 17-05.10.20*	USD	7 300 000		7 300 000	6 707 917	0,37	
CATERPILLAR INC 3.40000% 14-15.05.24*	USD	2 000 000	2 000 000				
CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 20-15.09.25*	USD	10 500 000	5 200 000	5 300 000	4 820 681	0,26	
CELGENE CORP 2.87500% 15-15.08.20*	USD	6 000 000	6 000 000				
CELGENE CORP 2.87500% 18-19.02.21*	USD	3 000 000	3 000 000				
CHARLES SCHWAB CORP 2.65000% 17-25.01.23*	USD	3 500 000	400 000	3 900 000	3 756 855	0,21	
CHEVRON CORP 2.41100% 15-03.03.22*	USD	7 000 000		7 000 000	6 598 013	0,36	
CIGNA CORP 3.20000% 19-17.09.20*	USD	3 500 000	3 500 000				
CISCO SYSTEMS INC 2.45000% 15-15.06.20*	USD	7 000 000	7 000 000				
CITIBANK NA 3.40000% 18-23.07.21*	USD	5 000 000	5 000 000				
CITIGROUP INC-SUB 4.40000% 15-10.06.25*	USD	4 106 000	4 106 000				
CNOOC FINANCE 2011 LTD-REG-S 4.25000% 11-26.01.21*	USD	3 000 000	3 000 000	6 000 000	5 576 238	0,31	
COCA-COLA CO/THE 1.87500% 15-27.10.20*	USD	4 700 000	4 700 000				
COOPERATIVE RABOBANK UA-REG-S 2.62500% 19-22.07.24*	USD	4 235 000		4 235 000	4 152 180	0,23	
CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.80000% 16-15.09.22*	USD	6 100 000		6 100 000	5 930 248	0,32	
CREDIT SUISSE NEW YORK BRANCH 2.80000% 20-08.04.22*	USD	4 750 000	4 750 000		4 519 116	0,25	
CUMMINS INC 0.75000% 20-01.09.25*	USD	3 300 000	3 300 000		3 041 099	0,17	
DANSKE BANK AS-REG-S 2.70000% 17-02.03.22*	USD	6 500 000	6 500 000		6 151 177	0,34	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-REG-S 2.82000% 17-19.01.22*	USD	5 000 000		5 000 000				
DIAGEO CAPITAL PLC 3.00000% 18-18.05.20*	USD	8 000 000		8 000 000				
DP WORLD PLC-REG-S 3.25000% 15-18.05.20*	USD	1 500 000		1 500 000				
DR HORTON INC 2.55000% 17-01.12.20*	USD	3 000 000			3 000 000	2 765 569	0,15	
EATON CORP 2.75000% 13-02.11.22*	USD	4 000 000		4 000 000				
EBAY INC 2.15000% 17-05.06.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
ECOLAB INC 2.37500% 17-10.08.22*	USD	2 200 000			2 200 000	2 094 556	0,11	
ECOLAB INC 4.35000% 11-08.12.21*	USD	3 191 000		3 191 000				
EDISON INTERNATIONAL 3.12500% 19-15.11.22*	USD		3 200 000		3 200 000	3 033 557	0,17	
EDISON INTERNATIONAL 4.95000% 20-15.04.25*	USD		2 350 000		2 350 000	2 363 307	0,13	
EDP FINANCE BV-REG-S 4.90000% 09-01.10.19*	USD	2 000 000		2 000 000				
EDP FINANCE BV-REG-S 5.25000% 14-14.01.21*	USD	7 000 000			7 000 000	6 514 367	0,36	
EDP FINANCE BV-REG-S 4.12500% 14-15.01.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
ELECTRONIC ARTS INC 3.70000% 16-01.03.21*	USD	5 735 000		5 735 000				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 4.25000% 18-14.09.23*	USD	6 449 000			6 449 000	6 484 729	0,36	
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 2.85000% 16-15.04.21*	USD	5 000 000			5 000 000	4 644 937	0,25	
ESTEE LAUDER COS INC 1.70000% 16-10.05.21*	USD	3 000 000	400 000		3 400 000	3 146 579	0,17	
ESTEE LAUDER COS INC 1.80000% 17-07.02.20*	USD	3 200 000		3 200 000				
FRESENIUS MED CARE US FIN II INC-144A 4.12500% 14-15.10.20*	USD	5 900 000	400 000	6 300 000				
FRESENIUS US FINANCE II INC-REG-S 4.25000% 14-01.02.21*	USD	1 500 000			1 500 000	1 394 073	0,08	
GENERAL ELECTRIC CO 3.15000% 12-07.09.22*	USD	2 000 000			2 000 000	1 919 079	0,11	
GENERAL ELECTRIC CO 2.50000% 14-28.03.20*	USD	5 500 000		5 500 000				
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.70000% 20-18.08.23*	USD		13 400 000	3 400 000	10 000 000	9 210 457	0,50	2 150 000
GEORGIA POWER CO 2.00000% 17-30.03.20*	USD	6 000 000		6 000 000				
GILEAD SCIENCES INC 2.55000% 15-01.09.20*	USD	3 512 000	500 000	4 012 000				
GILEAD SCIENCES INC 0.75000% 20-29.09.23*	USD		7 500 000		7 500 000	6 902 442	0,38	
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 3.12500% 18-14.05.21*	USD		6 300 000	6 300 000				
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 0.53400% 20-01.10.23*	USD		6 400 000		6 400 000	5 889 047	0,32	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.37500% 10-15.03.20*	USD	5 000 000		5 000 000				
GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25*	USD		7 522 000		7 522 000	7 627 283	0,42	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 2.25000% 19-01.04.23*	USD	10 400 000			10 400 000	9 853 856	0,54	1 000 000
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.45000% 20-02.10.23*	USD		3 000 000		3 000 000	3 028 926	0,17	1 000 000
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 1.75000% 20-01.04.26*	USD		5 600 000	5 600 000				
HOME DEPOT INC/THE 3.25000% 18-01.03.22*	USD	4 200 000		4 200 000				
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 1.85000% 16-01.11.21*	USD	2 500 000		2 500 000				
HUMANA INC 2.50000% 17-15.12.20*	USD	3 200 000			3 200 000	2 952 289	0,16	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.85000% 19-01.11.22*	USD		2 800 000		2 800 000	2 660 274	0,15	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.37500% 20-10.02.23*	USD		1 700 000	1 700 000				
IBM CREDIT LLC 1.80000% 17-20.01.21*	USD	4 000 000		4 000 000				
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 3.12500% 19-26.07.24*	USD	4 600 000		4 600 000				
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 15-21.07.22*	USD	2 025 000			2 025 000	1 943 939	0,11	
INGERSOLL RAND GLOBAL HLDG CO LTD 2.90000% 18-21.02.21*	USD	4 000 000			4 000 000	3 710 313	0,20	
INGERSOLL-RAND LUXEMBOURG FINANCE SA 2.62500% 14-01.05.20*	USD	2 500 000		2 500 000				
INTEL CORP 2.45000% 15-29.07.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 2.75000% 15-01.12.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP INC 4.00000% 13-15.10.23*	USD	2 000 000	2 000 000		4 000 000	4 039 193	0,22	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.90000% 17-27.01.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.00000% 19-15.05.24*	USD	6 000 000			6 000 000	5 971 079	0,33	
INTUIT INC 0.95000% 20-15.07.25*	USD		3 300 000		3 300 000	3 060 899	0,17	
JOHNSON & JOHNSON 0.55000% 20-01.09.25*	USD		10 000 000		10 000 000	9 190 270	0,50	
JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 13-25.01.23*	USD	3 000 000		3 000 000				
KELLOGG CO 4.00000% 10-15.12.20*	USD	487 000		487 000				
KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 6.85000% 09-15.02.20*	USD	2 880 000		2 880 000				
KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 14-01.03.21*	USD	5 000 000			5 000 000	4 626 587	0,25	
KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-144A 3.00000% 12-19.09.22*	USD	5 000 000			5 000 000	4 796 162	0,26	
KOREAN AIR LINES CO LTD-REG-S 2.00000% 19-04.09.22*	USD	15 000 000	700 000		15 700 000	14 690 324	0,80	
LAS VEGAS SANDS CORP 3.20000% 19-08.08.24*	USD	7 530 000		7 530 000				
MACQUARIE GROUP LTD-REG-S 6.00000% 10-14.01.20*	USD	1 000 000		1 000 000				
MCKESSON CORP 2.70000% 12-15.12.22*	USD	2 000 000			2 000 000	1 911 317	0,10	
MERCK & CO INC 3.87500% 10-15.01.21*	USD	3 000 000			3 000 000	2 763 310	0,15	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.40000% 18-08.01.21*	USD	7 000 000		7 000 000				
MICROSOFT CORP 2.00000% 15-03.11.20*	USD	7 000 000		7 000 000				
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.53500% 18-26.07.21*	USD	3 600 000	200 000		3 800 000	3 582 578	0,20	
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.21800% 19-07.03.22*	USD	6 000 000			6 000 000	5 715 084	0,31	500 000
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-144A 2.63200% 16-12.04.21*	USD	4 000 000		4 000 000				
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.60100% 17-11.09.22*	USD	6 100 000			6 100 000	5 823 642	0,32	
MOODY'S CORP 3.25000% 18-07.06.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
MOODY'S CORP 5.50000% 10-01.09.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
MPLX LP 4.87500% 16-01.12.24*	USD		5 000 000		5 000 000			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 2.40000% 14-09.12.19*	USD	4 000 000		4 000 000				
NATIONAL OILWELL VARCO INC 2.60000% 12-01.12.22*	USD	3 500 000	1 400 000	4 900 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 2.00000% 20-27.01.23*	USD		9 500 000		9 500 000	8 981 246	0,49	710 000
NATWEST GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23*	USD	2 000 000		2 000 000				
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 3.62500% 19-29.09.22*	USD	8 000 000			8 000 000	7 715 072	0,42	
NEVADA POWER CO 2.75000% 18-15.04.20*	USD	3 500 000		3 500 000				
NEWMONT GOLD CORP 5.12500% 09-01.10.19*	USD	4 000 000		4 000 000				
NISSAN MOTOR CO LTD-144A 3.04300% 20-15.09.23*	USD		3 300 000		3 300 000	3 072 320	0,17	
NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 4.25000% 12-21.09.22*	USD	3 000 000	3 930 000		6 930 000	6 766 399	0,37	
NUCOR CORP 4.12500% 10-15.09.22*	USD	3 600 000			3 600 000	3 508 283	0,19	
NVR INC 3.95000% 12-15.09.22*	USD		2 000 000		2 000 000	1 941 292	0,11	
ORACLE CORP 1.90000% 16-15.09.21*	USD	5 000 000		5 000 000				
ORACLE CORP 2.62500% 17-15.02.23*	USD	3 000 000			3 000 000	2 878 941	0,16	
ORANGE SA 1.62500% 16-03.11.19*	USD	3 500 000		3 500 000				
PEPSICO INC 0.75000% 20-01.05.23*	USD		2 500 000		2 500 000	2 320 227	0,13	
PEPSICO INC 1.70000% 16-06.10.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.62500% 17-18.02.22*	USD	2 000 000			2 000 000	1 890 038	0,10	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.50000% 17-02.11.22*	USD	3 000 000		3 000 000				
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.12500% 20-01.05.23*	USD		4 600 000		4 600 000	4 291 123	0,23	
PHILLIPS 66 3.70000% 20-06.04.23*	USD		2 000 000		2 000 000	1 966 973	0,11	
PHILLIPS 66 4.30000% 12-01.04.22*	USD	4 700 000		4 700 000		4 554 285	0,25	
PHILLIPS 66 PARTNERS LP 2.45000% 19-15.12.24*	USD	2 615 000		2 615 000				
PIONEER NATURAL RESOURCES CO 7.50000% 09-15.01.20*	USD	5 487 000		5 487 000				
QUEST DIAGNOSTICS INC 2.50000% 15-30.03.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
RABOBANK NEDERLAND NV 4.50000% 11-11.01.21*	USD		11 000 000		11 000 000	10 223 151	0,56	
RECKITT BENCKISER TREAS SERV-144A 2.37500% 17-24.06.22*	USD	2 500 000		2 500 000				
RELIANCE HOLDINGS USA INC-REG-S 5.40000% 12-14.02.22*	USD		5 140 000	5 140 000				
RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 5.40000% 12-14.02.22*	USD		5 140 000		5 140 000	4 971 775	0,27	
ROPER TECHNOLOGIES INC 3.00000% 15-15.12.20*	USD	3 500 000			3 500 000	3 225 335	0,18	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ROPER TECHNOLOGIES INC 1.00000% 20-15.09.25*	USD		3 500 000		3 500 000	3 222 564	0,18	
ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC 6.40000% 09-21.10.19*	USD	3 000 000		3 000 000				
SANOFI 3.37500% 18-19.06.23*	USD	4 000 000			4 000 000	3 974 022	0,22	
SANTANDER UK PLC 2.12500% 17-03.11.20*	USD	2 500 000		2 500 000				
SANTANDER UK PLC 2.10000% 20-13.01.23*	USD		4 400 000		4 400 000	4 171 759	0,23	
SANTANDER UK PLC 2.87500% 19-18.06.24*	USD	7 000 000			7 000 000	6 866 385	0,38	800 000
SEMPRA ENERGY 2.40000% 15-15.03.20*	USD	2 500 000		2 500 000				
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.87500% 16-10.05.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 3.25000% 15-27.05.25*	USD		3 000 000		3 000 000	3 061 544	0,17	
SINOPEC GROUP OVERSEAS-REG-S 2.50000% 17-13.09.22*	USD	5 000 000			5 000 000	4 718 643	0,26	
SOUTHWEST AIRLINES CO 2.65000% 15-05.11.20*	USD	8 000 000	500 000		8 500 000	7 810 807	0,43	
SOUTHWEST AIRLINES CO 2.75000% 17-16.11.22*	USD	3 000 000			3 000 000	2 838 122	0,16	
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.25000% 20-04.05.25*	USD		3 500 000		3 500 000	3 541 560	0,19	
STANDARD CHARTERED PLC-144A 3.05000% 16-15.01.21*	USD	3 500 000	1 349 000		4 849 000	4 484 700	0,25	
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 3.95000% 13-11.01.23*	USD		3 000 000		3 000 000	2 862 522	0,16	3 000 000
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 2.12500% 16-18.05.21*	USD		4 000 000	4 000 000				
STEEL DYNAMICS INC 2.40000% 20-15.06.25*	USD		3 300 000	3 300 000				
SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.10200% 18-17.01.23*	USD	5 000 000			5 000 000	4 839 608	0,27	460 000
TEXAS INSTRUMENTS INC 1.85000% 16-15.05.22*	USD	4 000 000			4 000 000	3 765 888	0,21	
TOTAL CAPITAL 4.45000% 10-24.06.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
TYSON FOODS INC 2.25000% 17-23.08.21*	USD	3 000 000			3 000 000			
UBS AG/LONDON-144A 2.45000% 17-01.12.20*	USD		4 500 000	2 000 000	2 500 000	2 300 843	0,13	
UBS GROUP AG-REG-S 3.49100% 17-23.05.23*	USD	2 000 000	7 000 000	9 000 000				
UNION PACIFIC CORP 3.20000% 18-08.06.21*	USD	5 100 000			5 100 000	4 778 325	0,26	
UNITEDHEALTH GROUP INC 2.87500% 12-15.03.22*	USD	3 000 000			3 000 000	2 839 817	0,16	
VISA INC 2.20000% 15-14.12.20*	USD		4 030 000		4 030 000	3 710 698	0,20	
VISA INC 2.80000% 15-14.12.22*	USD	4 500 000			4 500 000	4 343 495	0,24	
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 4.00000% 10-12.08.20*	USD	2 868 000		2 868 000				
WALMART INC 2.85000% 19-08.07.24*	USD	16 500 000		4 500 000	12 000 000	11 979 003	0,66	
WALMART INC 3.40000% 18-26.06.23*	USD		1 000 000		1 000 000	992 595	0,05	
WALT DISNEY CO 3.00000% 19-15.09.22*	USD		3 000 000	3 000 000				
WALT DISNEY CO/THE 2.30000% 16-12.02.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 18-25.01.21*	USD	3 100 000			3 100 000	2 868 347	0,16	
WILLIS TOWERS WATSON PLC 5.75000% 11-15.03.21*	USD	3 700 000			3 700 000	3 475 322	0,19	
ZOETIS INC 3.45000% 15-13.11.20*	USD	5 000 000		5 000 000				
Total USD						489 574 324	26,81	

Total Notes, fester Zins

595 346 873 32,60

Notes, Nullcoupon

EUR

BERKSHIRE HATHAWAY INC 0.00000% 20-12.03.25*	EUR		6 800 000		6 800 000	7 308 182	0,40	
DASSAULT SYSTEMES SE-REG-S 0.00000% 19-16.09.22*	EUR	3 500 000			3 500 000	3 778 420	0,21	1 400 000
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 0.00000% 20-10.03.24*	EUR		2 300 000	2 300 000				
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.00000% 20-15.03.23*	EUR		6 600 000		6 600 000	7 127 379	0,39	
SAP SE-REG-S 0.00000% 20-17.05.23*	EUR		6 900 000		6 900 000	7 457 495	0,41	3 200 000
Total EUR						25 671 476	1,41	

Total Notes, Nullcoupon

25 671 476 1,41

Notes, variabler Zins

EUR

ALLIANZ SE-SUB 5.625%/VAR 12-17.10.42*	EUR	6 000 000	2 000 000		8 000 000	9 485 874	0,52	
Total EUR						9 485 874	0,52	

USD

ARCELORMITTAL 6.250%/RATING LINKED 12-25.02.22*	USD	6 328 000		6 328 000				
BANK OF AMERICA CORP 2.328%/VAR 17-01.10.21*	USD	6 000 000			6 000 000	5 512 500	0,30	
BANK OF AMERICA NA 3.335%/3M LIBOR+65BP 19-25.01.23*	USD	2 200 000			2 200 000	2 097 447	0,11	
BHP BILLITON FINANCE USA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 15-19.10.75*	USD	9 000 000	2 600 000		11 600 000	10 661 230	0,58	
CITIGROUP INC 3M LIBOR+143BP 16-01.09.23*	USD	4 000 000		4 000 000				
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.222%/VAR 20-18.09.24*	USD		10 000 000		10 000 000	9 251 353	0,51	1 718 000
GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.876%/3M LIBOR+82.1BP 17-31.10.22*	USD	3 200 000			3 200 000	3 010 467	0,16	
HSBC HOLDINGS PLC 3M LIBOR+150BP 16-05.01.22*	USD	3 000 000		3 000 000				
JPMORGAN CHASE & CO 4.023%/3M LIBOR+100BP 18-05.12.24*	USD		7 500 000		7 500 000	7 561 274	0,41	
JPMORGAN CHASE & CO 3.207%/VAR 19-01.04.23*	USD	16 000 000		8 000 000	8 000 000	7 637 311	0,42	
LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907%/3M LIBOR+81BP 17-07.11.23*	USD	7 000 000	3 625 000	7 125 000	3 500 000	3 339 592	0,18	3 500 000
LLOYDS BANKING GROUP PLC 1.326%/VAR 20-15.06.23*	USD		2 800 000	2 800 000				
LOTTE PROP & DEVEP CO LTD-REG-S 3M LIBOR+77.5BP 19-06.08.22*	USD		4 000 000		4 000 000	3 665 813	0,20	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3M LIBOR+65BP 19-08.03.21*	USD	1 100 000		1 100 000				
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3M LIBOR+63BP 20-25.05.24*	USD	14 000 000		4 000 000	10 000 000	9 153 690	0,50	
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC VAR 20-10.07.24*	USD		6 700 000		6 700 000	6 205 855	0,34	280 000
NATWEST GROUP PLC 4.269%/VAR 19-22.03.25*	USD		6 000 000	2 000 000	4 000 000	3 992 017	0,22	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3M LIBOR+145BP 19-15.08.22*	USD	5 000 000			5 000 000			
STANDARD CHARTERED PLC-144A 3M LIBOR+115BP 18-20.01.23*	USD	1 900 000		1 900 000				
STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 2.819%/VAR 20-30.01.26*	USD		9 300 000	9 300 000				
SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3M LIBOR+74BP 17-18.10.22*	USD	4 000 000			4 000 000	3 685 217	0,20	
UBS GROUP AG-REG-S 3M LIBOR+178BP 16-14.04.21*	USD	2 000 000		2 000 000				
US BANK NA/CINCINNATI OH 3.104%/VAR 18-21.05.21*	USD	6 300 000			6 300 000			
WPP FINANCE UK 4.750%/RATING LINKED 12-21.11.21*	USD	2 000 000		2 000 000				
Total USD						75 773 766	4,15	

Total Notes, variabler Zins

85 259 640 4,67

Medium-Term Notes, fester Zins

CAD

BP CAPITAL MARKETS PLC 3.49700% 13-09.11.20*	CAD	10 431 000			10 431 000	7 194 050	0,39	
Total CAD						7 194 050	0,39	

CHF

AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD-REG-S 0.20310% 20-03.06.24*	CHF		9 000 000		9 000 000	8 766 000	0,48	815 000
BANK OF MONTREAL-REG-S 0.05000% 18-30.12.22*	CHF	2 000 000			2 000 000	2 014 000	0,11	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.69700% 18-22.03.21*	CHF	5 400 000	500 000		5 900 000	5 894 469	0,32	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.45000% 17-14.03.22*	CHF	1 200 000			1 200 000	1 206 000	0,07	200 000
DANSKE BANK AS-REG-S 0.62500% 19-24.11.22*	CHF	2 600 000			2 600 000	2 624 700	0,14	
EMIRATES NBD PJSC 0.62500% 18-09.02.23*	CHF		2 700 000		2 700 000	2 712 150	0,15	215 000

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.85000% 13-25.10.19*	CHF	4 900 000		4 900 000				
LAFARGEHOLCIM HELVETIA FINANCE-REG-S 1.05000% 20-11.04.22*	CHF		6 000 000		6 000 000	6 090 000	0,33	200 000
LEASEPLAN CORP NV 2.37500% 12-15.10.20*	CHF	600 000			600 000	600 540	0,03	
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.12500% 19-13.09.23*	CHF	3 800 000			3 800 000	3 769 600	0,21	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.60000% 16-23.03.21*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 024 000	0,28	
Total CHF						38 701 459	2,12	
EUR								
ABN AMRO BANK NV-REG-S 0.25000% 18-03.12.21*	EUR	6 600 000		6 600 000				
ALD SA-REG-S 0.37500% 19-18.07.23*	EUR	3 400 000	1 600 000	5 000 000				
AMCO - ASSET MANAGEMENT CO SPA-REG-S 1.50000% 20-17.07.23*	EUR		3 300 000		3 300 000	3 646 598	0,20	
ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 2.50000% 13-29.04.21*	EUR		2 500 000	2 500 000				
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 0.62500% 16-01.06.21*	EUR	3 000 000	2 000 000	5 000 000				
APPLE INC 1.00000% 14-10.11.22*	EUR		3 740 000		3 740 000	4 134 668	0,23	1 400 000
ARION BANKI HF-REG-S 1.62500% 16-01.12.21*	EUR		10 000 000		10 000 000	10 969 674	0,60	
ATHENE GLOBAL FUNDING 1.87500% 20-23.06.23*	EUR		6 000 000		6 000 000	6 697 807	0,37	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S 0.75000% 17-11.09.22*	EUR	2 700 000		2 700 000				
BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.50000% 18-16.11.22*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 368 465	0,24	1 800 000
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 2.75000% 13-25.03.25*	EUR		9 671 000		9 671 000	11 487 345	0,63	
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUR-REG-S 0.50000% 19-12.09.23*	EUR	9 300 000	2 700 000		12 000 000	12 850 789	0,70	4 500 000
BMW FINANCE NV-REG-S 0.87500% 15-17.11.20*	EUR		3 900 000	3 900 000				
BMW FINANCE NV-REG-S 0.62500% 19-06.10.23*	EUR	2 400 000		2 400 000				
BNP PARIBAS-REG-S 1.12500% 18-22.11.23*	EUR	6 500 000		1 300 000	5 200 000	5 772 019	0,32	
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.62500% 19-23.04.22*	EUR	2 800 000		2 800 000				
BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.37500% 19-14.09.24*	EUR		6 700 000		6 700 000	7 302 676	0,40	200 000
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.11700% 16-25.01.24*	EUR	5 000 000		5 000 000				
BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-REG-S 0.62500% 16-10.03.21*	EUR	5 000 000		5 000 000				
COMMERZBANK AG-REG-S 0.50000% 18-06.12.21*	EUR	6 000 000			6 000 000	6 508 823	0,36	600 000
CONTI-GUMMI FINANCE BV 2.12500% 20-27.11.23*	EUR		4 000 000		4 000 000	4 522 274	0,25	200 000
COVESTRO AG-REG-S 0.87500% 20-03.02.26*	EUR		3 400 000	3 400 000				
CREDIT AGRICOLE SA LONDON 2.37500% 13-27.11.20*	EUR		2 000 000	2 000 000				
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.75000% 19-07.02.23*	EUR	3 800 000		3 800 000				
DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE-REG-S 0.37500% 17-30.10.21*	EUR	4 000 000		4 000 000				
DIAGEO FINANCE PLC-REG-S 0.25000% 18-22.10.21*	EUR	3 900 000		3 900 000				
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23*	EUR		16 900 000	8 900 000	8 000 000	8 660 693	0,47	
ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 0.62500% 20-17.04.25*	EUR		3 100 000		3 100 000	3 443 737	0,19	2 500 000
ESSILORLUXOTTICA SA-REG-S 0.25000% 20-05.01.24*	EUR		3 900 000		3 900 000	4 241 122	0,23	2 400 000
EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA-REG-S 0.30000% 19-06.03.22*	EUR	2 200 000			2 200 000	2 357 183	0,13	2 200 000
FCA BANK SPAIN/IRELAND-REG-S 1.25000% 19-21.06.22*	EUR	3 000 000	2 000 000		5 000 000	5 471 144	0,30	500 000
FCA BANK SPAIN/IRELAND-REG-S 0.25000% 20-28.02.23*	EUR		5 700 000	5 700 000				
FCA BANK SPAIN/IRELAND-REG-S 0.50000% 20-18.09.23*	EUR		4 700 000		4 700 000	5 058 049	0,28	
GLENORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 3.37500% 13-30.09.20*	EUR	2 000 000		2 000 000				
GLENORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.25000% 15-17.03.21*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 397 279	0,30	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.50000% 14-18.10.21*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 324 781	0,18	
HITACHI CAPITAL UK PLC-REG-S 0.12500% 19-29.11.22*	EUR		3 800 000		3 800 000	4 043 249	0,22	
HSBC HOLDINGS PLC-REG-S 1.50000% 16-15.03.22*	EUR	7 857 000			7 857 000	8 642 423	0,47	2 188 000
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-REG-S 1.12500% 19-14.08.23*	EUR		5 675 000		5 675 000	6 256 056	0,34	5 575 000
ING GROEP NV-REG-S 0.75000% 17-09.03.22*	EUR	2 000 000		2 000 000				
J.P.MORGAN CHASE & CO 2.75000% 12-24.08.22*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 540 046	0,25	3 950 000
JEFFERIES GROUP LLC-REG-S 1.00000% 19-19.07.24*	EUR	5 000 000			5 000 000			
KBC GROEP NV-REG-S 1.00000% 16-26.04.21*	EUR	5 100 000		5 100 000				
KERING SA-REG-S 0.25000% 20-13.05.23*	EUR		2 800 000		2 800 000	3 042 320	0,17	600 000
LANDSBANKINN HF-REG-S 1.62500% 16-15.03.21*	EUR	9 000 000		7 606 000	1 394 000	1 512 445	0,08	
LANDSBANKINN HF-REG-S 0.50000% 20-20.05.24*	EUR		5 200 000	5 200 000				
LEASEPLAN CORP NV-REG-S 1.00000% 16-24.05.21*	EUR	3 100 000	3 400 000	3 100 000	3 400 000	3 676 289	0,20	
LEASEPLAN CORP NV-REG-S 1.37500% 19-07.03.24*	EUR		2 246 000		2 246 000	2 443 685	0,13	2 246 000
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 0.25000% 19-04.10.22*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 239 848	0,18	500 000
LLOYDS BANK PLC-SUB 6.50000% 10-24.03.20*	EUR	5 800 000		5 800 000				
LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 0.50000% 19-30.04.21*	EUR	3 000 000		3 000 000				
LONDON STOCK EX GROUP PLC-REG-S 0.87500% 17-19.09.24*	EUR		8 100 000		8 100 000	8 971 028	0,49	
LUMINOR BK ESTON-REG-S 1.50000% 18-18.10.21*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 232 117	0,18	
MACQUARIE BANK LTD-SUB 6.00000% 10-21.09.20*	EUR	2 700 000		2 700 000				
MCDONALD'S CORP-REG-S 4.00000% 11-17.02.21*	EUR	6 500 000			6 500 000	7 109 027	0,39	
MONDI FINANCE PLC 3.37500% 12-28.09.20*	EUR	3 060 000	400 000	3 460 000				
MORGAN STANLEY 1.00000% 16-02.12.22*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 507 268	0,30	5 000 000
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 0.62500% 18-30.08.23*	EUR	3 100 000			3 100 000	3 412 148	0,19	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-SUB 6.75000% 10-22.07.20*	EUR	2 000 000		2 000 000				
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 5.50000% 10-23.03.20*	EUR	2 580 000		2 580 000				
NESTLE FINANCE INTL LIMITED-REG-S 2.12500% 13-10.09.21*	EUR		3 800 000		3 800 000	4 184 009	0,23	362 000
NOMURA EUROPE FINANCE NV-REG-S 1.12500% 15-03.06.20*	EUR	7 000 000		7 000 000				
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.50000% 18-19.01.22*	EUR	5 000 000	300 000		5 300 000	5 737 424	0,31	800 000
NYKREDIT REALKREDIT A/S-REG-S 0.25000% 19-20.01.23*	EUR		3 900 000		3 900 000	4 208 861	0,23	
OP CORPORATE BANK PLC 0.37500% 19-19.06.24*	EUR		5 000 000		5 000 000	5 414 011	0,30	
RCI BANQUE SA-REG-S 0.25000% 18-12.07.21*	EUR	4 000 000		4 000 000				
RCI BANQUE SA-REG-S 0.75000% 19-10.04.23*	EUR	6 100 000		6 100 000				
ROCHE HOLDINGS INC 6.50000% 09-04.03.21*	EUR		2 000 000	2 000 000				
RYANAIR DAC-REG-S 1.87500% 14-17.06.21*	EUR	6 500 000		2 450 000	4 050 000	4 372 337	0,24	4 050 000
SANOFI-REG-S 1.87500% 13-04.09.20*	EUR		5 300 000	5 300 000				
SCANIA CV AB-REG-S 0.50000% 20-06.10.23*	EUR		3 200 000		3 200 000	3 458 410	0,19	
SECURITAS AB-REG-S 2.62500% 13-22.02.21*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 264 289	0,18	
SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 1.00000% 14-06.04.22*	EUR		2 500 000		2 500 000	2 742 214	0,15	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 0.50000% 18-13.03.23*	EUR	4 000 000		4 000 000				
SKY PLC-REG-S 1.50000% 14-15.09.21*	EUR	6 000 000	2 000 000		8 000 000	8 756 950	0,48	700 000
SOCIETE GENERALE-REG-S 0.25000% 18-18.01.22*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 332 579	0,24	
SOCIETE GENERALE-REG-S 1.00000% 16-01.04.22*	EUR	2 000 000		2 000 000				
STE AUTOROUTES PARIS RHIN RHONE-REG-S 1.12500% 14-15.01.21*	EUR	2 700 000		2 700 000				
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25*	EUR		2 200 000		2 200 000	2 480 896	0,14	
TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 2.24200% 14-27.05.22*	EUR		6 500 000	6 500 000				
TELEKOM FINANZMANAGEMENT GMBH-REG-S 3.12500% 13-03.12.21*	EUR	2 500 000		2 500 000				
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA-REG-S 0.87500% 15-02.02.22*	EUR		4 628 000		4 628 000	5 048 036	0,28	
THALES SA-REG-S 0.75000% 16-07.06.23*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 193 404	0,12	
TORONTO DOMINION BANK-REG-S 0.62500% 18-20.07.23*	EUR	10 000 000			10 000 000	10 998 634	0,60	4 000 000
TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD-REG-S 0.25000% 19-09.04.24*	EUR	8 800 000		200 000	8 600 000	9 355 757	0,51	
TOYOTA MOTOR FINANCE NL BV-REG-S 0.62500% 18-26.09.23*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 299 791	0,18	
UBS AG LONDON-REG-S 0.12500% 17-05.11.21*	EUR	2 600 000		2 600 000				
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG-REG-S 0.62500% 19-01.04.22*	EUR	5 900 000		2 000 000	3 900 000	4 231 113	0,23	
Total EUR						265 921 787	14,56	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
GBP								
BANK OF AMERICA CORP-REG-S-SUB 5.50000% 06-22.11.21*	GBP	2 000 000			2 000 000	2 502 838	0,14	
BANK OF MONTREAL-REG-S 1.50000% 19-18.12.24*	GBP		6 000 000		6 000 000	7 375 405	0,40	2 700 000
BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 1.37500% 19-05.12.23*	GBP		8 300 000		8 300 000	10 064 449	0,55	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTEL-REG-S 1.37500% 18-20.12.21*	GBP	2 000 000			2 000 000	2 403 670	0,13	
BMW FINANCE NV-REG-S 2.37500% 15-01.12.21*	GBP	3 000 000			3 000 000	3 640 703	0,20	
BMW INTERNATIONAL INVEST BV-REG-S 1.00000% 17-17.11.21*	GBP	3 000 000			3 000 000	3 583 527	0,20	
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 1.75000% 19-21.11.22*	GBP		5 000 000	5 000 000				
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC-REG-S 1.50000% 20-23.06.23*	GBP		5 000 000		5 000 000	6 019 271	0,33	5 000 000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 1.00000% 20-11.02.23*	GBP		7 100 000	7 100 000				
NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.00000% 17-11.06.21*	GBP	3 000 000		3 000 000				
SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.62500% 19-15.12.23*	GBP	8 000 000	900 000		8 900 000	10 949 128	0,60	
SWEDBANK AB-REG-S 1.25000% 17-29.12.21*	GBP	7 990 000			7 990 000	9 585 674	0,52	
XSTRATA CANADA FIN CORP 7.37500% 08-27.05.20*	GBP		1 800 000	1 800 000				
Total GBP						56 124 664	3,07	

USD

ABN AMRO BANK NV-SUB 6.25000% 11-27.04.22*	USD	3 000 000		3 000 000				
AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 5.25000% 18-11.10.23*	USD	4 000 000			4 000 000	3 970 066	0,22	
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.45000% 15-24.09.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.65000% 18-12.02.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 3.37500% 18-10.12.21*	USD	5 000 000		5 000 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.95000% 20-10.05.23*	USD		7 200 000	7 200 000				
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 1.20000% 20-08.07.25*	USD		13 200 000	7 000 000	6 200 000	5 738 972	0,31	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 2.70000% 15-16.11.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
BANK OF AMERICA CORP 2.15100% 16-09.11.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
BANK OF MONTREAL 2.10000% 17-15.06.20*	USD	6 000 000	500 000	6 500 000				
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.45000% 15-27.11.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
BB&T CORP 2.15000% 17-01.02.21*	USD	2 000 000		2 000 000				
BLACK SEA TRADE & DEVELOPMT BK-REG-S 4.87500% 16-06.05.21*	USD	5 050 000		5 050 000				
CENTRAL NIPPON EXPRESSWAY CO LTD-REG-S 2.09100% 16-14.09.21*	USD	2 000 000		2 000 000				
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 3.37500% 17-10.01.22*	USD	5 700 000			5 700 000	5 408 727	0,30	
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-REG-S 2.12500% 16-06.04.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
DANSKE BANK AS-REG-S 2.80000% 16-10.03.21*	USD	2 500 000		2 500 000				
DANSKE BANK AS-REG-S 2.20000% 17-02.03.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
EXIMCH/ AVI FUNDING CO LTD-REG-S 2.85000% 15-16.09.20*	USD	4 700 000		4 700 000				
HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 2.00000% 17-12.06.20*	USD	4 500 000	500 000	5 000 000				
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.00000% 16-18.03.21*	USD	2 000 000			2 000 000	1 853 431	0,10	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.75000% 17-18.09.20*	USD	3 200 000		3 200 000				
ICICI BANK LTD/DUBAI-REG-S 3.12500% 15-12.08.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
JAPAN TOBACCO INC-REG-S 2.00000% 16-13.04.21*	USD	6 000 000	2 500 000		8 500 000	7 853 186	0,43	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.15000% 11-15.10.21*	USD	6 000 000		6 000 000		5 672 077	0,31	
JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.30000% 19-07.06.21*	USD	3 000 000		3 000 000		2 792 753	0,15	
KOOKMIN BANK-REG-S 2.12500% 15-21.10.20*	USD	3 000 000		3 000 000		2 758 896	0,15	
KOOKMIN BANK-REG-S 3.62500% 18-23.10.21*	USD	6 500 000	300 000	6 800 000		6 433 222	0,35	
KOREA GAS CORP-REG-S 1.87500% 16-18.07.21*	USD	3 500 000		3 500 000		3 250 796	0,18	
LLOYDS BANK PLC-REG-S-SUB 6.5000% 10-14.09.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC-REG-S-2.37500% 15-30.09.20*	USD	2 500 000		2 500 000				
NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.37500% 17-17.11.22*	USD	6 800 000			6 800 000	6 497 450	0,36	500 000
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-REG-S 2.15000% 17-13.07.20*	USD	2 250 000	300 000	2 550 000				
NTT FINANCE CORP-REG-S 1.90000% 16-21.07.21*	USD	4 000 000			4 000 000	3 719 097	0,20	
PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 1.90000% 16-15.03.21*	USD	1 900 000		1 900 000		1 756 665	0,10	
RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.87500% 16-19.07.21*	USD	5 000 000			5 000 000	4 650 057	0,25	
ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 2.00000% 15-13.03.20*	USD	6 000 000		6 000 000				
ROYAL BANK OF CANADA 2.12500% 17-02.03.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
SOCIETE GENERALE-REG-S 3.25000% 17-12.01.22*	USD	2 000 000			2 000 000	1 890 084	0,10	
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT-REG-S 2.75000% 17-04.05.22*	USD	1 000 000	6 000 000	7 000 000		6 602 080	0,36	
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 2.45000% 16-30.03.21*	USD	3 000 000		3 000 000		2 785 916	0,15	
SWEDBANK AB-REG-S 2.65000% 16-10.03.21*	USD	3 900 000	1 100 000	5 000 000		4 641 295	0,25	200 000
TORONTO-DOMINION BANK 3.25000% 19-11.03.24*	USD	4 000 000		4 000 000		3 983 939	0,22	
TORONTO-DOMINION BANK 0.75000% 20-12.06.23*	USD		8 000 000	8 000 000		7 389 483	0,40	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.45000% 18-20.09.23*	USD	4 400 000		4 400 000		4 385 030	0,24	
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.90000% 20-30.03.23*	USD		3 200 000	3 200 000		3 117 122	0,17	200 000
UBS AG LONDON-REG-S 2.20000% 17-08.06.20*	USD	4 200 000		4 200 000				
Total USD						97 150 343	5,32	

Total Medium-Term Notes, fester Zins

465 092 303 25,47

Medium-Term Notes, Nullcoupon

CHF

BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 0.00000% 19-24.09.21*	CHF	4 400 000			4 400 000	4 316 125	0,24	
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24*	CHF		5 300 000		5 300 000	5 366 250	0,29	
Total CHF						9 682 375	0,53	

EUR

BMW FINANCE NV-REG-S 0.00000% 20-14.01.23*	EUR		6 800 000		6 800 000	7 317 838	0,40	100 000
E.ON SE-REG-S 0.00000% 19-24.10.22*	EUR		7 500 000		7 500 000	8 096 210	0,44	
E.ON SE-REG-S 0.00000% 20-18.12.23*	EUR		5 000 000		5 000 000	5 391 278	0,30	
HENKEL AG & CO KGAA-REG-S 0.00000% 16-13.09.21*	EUR		5 500 000		5 500 000	5 934 447	0,32	2 050 000
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.00000% 20-11.02.24*	EUR		12 800 000	2 800 000	10 000 000	10 797 898	0,59	2 300 000
SANOFI-REG-S 0.00000% 19-21.03.22*	EUR	8 000 000		8 000 000				
UNILEVER NV-REG-S 0.00000% 17-31.07.21*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 396 600	0,30	5 000 000
VOLVO TREASURY AB-REG-S 0.00000% 20-11.02.23*	EUR		10 200 000		10 200 000	10 985 020	0,60	
VOLVO TREASURY AB-REG-S 0.00000% 20-11.02.23*	EUR		10 200 000	10 200 000				
Total EUR						53 919 292	2,95	

Total Medium-Term Notes, Nullcoupon

63 601 667 3,48

Medium-Term Notes, variabler Zins

EUR

ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 2.875%VAR 15-30.06.25*	EUR	2 000 000		2 000 000				
BANK OF AMERICA CO-REG-S 0.736%/3M EURIBOR+83BP 17-07.02.22*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 242 136	0,18	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3M EURIBOR+55BP 20-21.04.23*	EUR		8 200 000	8 200 000				
ING GROEP NV-REG-S 3M EURIBOR+85BP 18-20.09.23*	EUR	3 100 000		3 100 000				

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TOTAL SE-REG-S-SUB 2.250%/VAR 15-PRP*	EUR	2 000 000	100 000	2 100 000				
TOTAL SE-REG-S-SUB 3.875%/VAR 16-PRP*	EUR	2 000 000	10 790 000	4 200 000	8 590 000	9 671 085	0,53	
Total EUR						12 913 221	0,71	
GBP								
AVIVA PLC-SUB 6.625%/6M LIBOR+413.6BP 11-03.06.41*	GBP		6 200 000		6 200 000	7 617 055	0,42	
Total GBP						7 617 055	0,42	
USD								
ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 5.500%/VAR 14-26.05.25*	USD	4 000 000		4 000 000				
KOREA DEVELOPMENT BANK 3M LIBOR+35BP 20-18.02.23*	USD		7 200 000	7 200 000				
MORGAN STANLEY 3M LIBOR+140BP 16-24.10.23*	USD		10 000 000		10 000 000	9 335 117	0,51	
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 3.622%/VAR 19-26.04.23*	USD	5 500 000			5 500 000	5 250 270	0,29	
OVERSEA-CHINESE BANKING-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-15.10.24*	USD	3 000 000		3 000 000				
ROYAL BANK OF CANADA 3M LIBOR+66BP 18-05.10.23*	USD	8 000 000			8 000 000	7 396 340	0,41	
Total USD						21 981 728	1,20	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						42 512 004	2,33	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
AMGEN INC 0.41000% 16-08.03.23*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 070 000	0,28	
GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.75000% 16-30.11.21*	CHF	4 000 000			4 000 000	4 107 500	0,22	
GENERAL ELECTRIC CO 3.12500% 04-06.12.19*	CHF	5 000 000		5 000 000				
TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA-REG-S 0.60000% 20-07.11.22*	CHF		4 400 000		4 400 000	3 961 375	0,22	
UBS AG/LONDON-REG-S 0.17000% 20-13.05.22*	CHF		6 000 000		6 000 000	6 048 000	0,33	
Total CHF						19 186 875	1,05	
EUR								
ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23*	EUR	2 200 000			2 200 000	2 438 201	0,13	
ALBEMARLE CORPORATION-REG-S 1.87500% 14-08.12.21*	EUR	3 500 000		3 500 000				
ALLERGAN FUNDING SCS 0.50000% 17-01.06.21*	EUR	5 400 000		5 400 000				
ALTRIA GROUP INC 1.00000% 19-15.02.23*	EUR	7 000 000		7 000 000				
AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.00000% 12-12.07.21*	EUR	2 500 000		2 500 000				
APT PIPELINES LTD-REG-S 1.37500% 15-22.03.22*	EUR	4 700 000			4 700 000	5 136 059	0,28	3 200 000
AUTOLIV INC-REG-S 0.75000% 18-26.06.23*	EUR		7 000 000		7 000 000	7 560 836	0,41	1 315 000
BERKSHIRE HATHAWAY INC 0.25000% 17-17.01.21*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 390 966	0,30	
BOOKING HOLDINGS INC 0.80000% 17-10.03.22*	EUR	3 000 000			3 000 000	3 264 307	0,18	1 300 000
CAPGEMINI SA-REG-S 0.50000% 16-09.11.21*	EUR	3 300 000			3 300 000	3 571 704	0,20	600 000
CARNIVAL CORP 1.87500% 15-07.11.22*	EUR		3 000 000	3 000 000				
CETIN FINANCE BV-REG-S 1.42300% 16-06.12.21*	EUR	7 800 000	500 000		8 300 000	9 049 227	0,50	
CNP ASSURANCES-REG-S-SUB 1.87500% 16-20.10.22*	EUR		7 600 000		7 600 000	8 417 457	0,46	2 400 000
COCA-COLA CO/THE 0.12500% 19-22.09.22*	EUR	4 100 000		4 100 000				
DIGITAL EURO FINCO LLC-REG-S 2.62500% 16-15.04.24*	EUR		12 000 000		12 000 000	13 984 670	0,77	
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 0.40000% 17-15.01.21*	EUR	4 700 000			4 700 000	5 040 215	0,47	917 000
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 0.12500% 19-03.12.22*	EUR		5 000 000		5 000 000	5 405 176	0,30	600 000
MAGNA INTERNATIONAL INC 1.90000% 15-24.11.23*	EUR	2 000 000			2 000 000	2 269 700	0,12	1 380 000
MERCK & CO INC 0.50000% 16-02.11.24*	EUR		10 000 000		10 000 000	11 061 057	0,61	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.37500% 19-09.04.24*	EUR		4 000 000	4 000 000				
MICROSOFT CORP 2.12500% 13-06.12.21*	EUR		9 000 000	9 000 000				
MYLAN NV-REG-S 2.25000% 16-22.11.24*	EUR		6 300 000		6 300 000	7 218 038	0,40	3 284 000
NIDEC CORP-REG-S 0.48700% 18-27.09.21*	EUR	4 000 000			4 000 000	4 311 816	0,24	
NOVARTIS FINANCE SA-REG-S 0.75000% 14-09.11.21*	EUR		2 000 000	2 000 000				
ORLEN CAPITAL AB-REG-S 2.50000% 14-30.06.21*	EUR	3 360 000	3 000 000	6 360 000				
SABIC CAPITAL BV-REG-S 2.75000% 13-20.11.20*	EUR	4 500 000			4 500 000	4 855 750	0,27	
SAP SE-REG-S 0.25000% 18-10.03.22*	EUR	6 300 000		6 300 000				
STRYKER CORP 1.12500% 18-30.11.23*	EUR	5 000 000			5 000 000	5 571 576	0,31	
SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S-SUB 4.00000% 10-09.11.20*	EUR	3 000 000	1 000 000		4 000 000	4 324 589	0,24	
SWISSCOM VIA LUNAR FUNDG V-REG-S LPN 1.87500% 14-08.09.21*	EUR	3 000 000		3 000 000				
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-REG-S 1.12500% 18-21.11.22*	EUR	3 200 000	1 800 000		5 000 000	5 504 187	0,30	2 700 000
TALENT YIELD EURO LTD-REG-S 1.43500% 15-07.05.20*	EUR	6 450 000	1 300 000	7 750 000				
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.50000% 15-01.12.20*	EUR	4 000 000		4 000 000				
THREE GORGE FIN II CYM ISLANDS LT-REG-S 1.70000% 15-10.06.22*	EUR		3 500 000		3 500 000	3 841 204	0,21	
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 0.50000% 17-30.03.21*	EUR	2 400 000		2 400 000				
WINTERSHALL DEA FINANCE BV-REG-S 0.45200% 19-25.09.23*	EUR	9 400 000		9 400 000				
Total EUR						121 786 736	6,67	
GBP								
BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 8.62500% 94-26.03.20*	GBP	2 000 000		2 000 000				
FRIENDS LIFE HOLDINGS PLC-REG-S-SUB 8.25000% 11-21.04.22*	GBP	3 539 000	500 000		4 039 000	5 320 187	0,29	
LANDESBANK BADEN-WUERTEMBERG-REG-S 1.50000% 20-03.02.25*	GBP		4 800 000		4 800 000	5 822 902	0,32	4 300 000
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 2.87500% 14-20.11.20*	GBP		6 035 000		6 035 000	7 174 870	0,39	
Total GBP						18 317 959	1,00	
USD								
AAREAL BANK AG-REG-S 2.75000% 17-09.10.20*	USD	5 854 000			5 854 000	5 374 383	0,29	
AT&T INC 2.80000% 16-17.02.21*	USD	2 794 000		2 794 000				
AZURE ORBIT III INTL FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 16-21.03.21*	USD		9 205 000		9 205 000	8 507 308	0,47	
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 3.40000% 14-01.09.24*	USD	2 000 000			2 000 000	2 018 491	0,11	
CENTRAL NIPPON EXPRESSWAY CO LTD-REG-S 2.36200% 16-28.05.21*	USD	2 000 000		2 000 000				
EMIRATES NBD PJSC-REG-S 3.25000% 17-14.11.22*	USD	2 300 000			2 300 000	2 191 046	0,12	
GLENCORE FUNDING LLC-REG-S 4.62500% 14-29.04.24*	USD		5 800 000		5 800 000	5 870 120	0,32	
HSBC BANK MIDDLE EAST LTD-REG-S 2.75000% 14-01.10.19*	USD	1 700 000		1 700 000				
KOMATSU FINANCE AMERICA INC-REG-S 0.84900% 20-09.09.23*	USD		13 800 000		13 800 000	12 691 417	0,69	
MIZUHO FINANCIAL GRP CAYMAN 2-REG-S-SUB 4.20000% 12-18.07.22*	USD		3 000 000		3 000 000	2 900 595	0,16	1 967 000
QUALCOMM INC 2.25000% 15-20.05.20*	USD	4 000 000		4 000 000				
REYNOLDS AMERICAN INC 4.00000% 15-12.06.22*	USD	5 852 000			5 852 000	5 667 056	0,31	
SIMON PROPERTY GROUP LP 2.50000% 15-01.09.20*	USD	5 000 000		5 000 000				
SIMON PROPERTY GROUP LP 3.50000% 15-01.09.25*	USD		2 600 000		2 600 000	2 618 476	0,14	
SUMITOMO MITSUI FIN & LEASING CO-REG-S 2.51200% 20-22.01.25*	USD		7 200 000		7 200 000	6 930 374	0,38	200 000
TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLD CORP-REG-S 1.62500% 20-24.09.25*	USD		2 900 000	2 900 000				
Total USD						54 769 266	3,00	
Total Anleihen, fester Zins						214 060 836	11,72	

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Anleihen, Nullcoupon								
EUR								
NOVARTIS FINANCE SA-REG-S 0.00000% 17-31.03.21*	EUR	3 780 000		3 780 000				
Total EUR							0,00	
USD								
BRITISH GAS INTERNATIONAL FINANCE BV 0.00000% 91-04.11.21*	USD	6 000 000	400 000		6 400 000	5 821 336	0,32	
Total USD						5 821 336	0,32	
Total Anleihen, Nullcoupon						5 821 336	0,32	
Anleihen, variabler Zins								
CHF								
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-SUB 3.500%/VAR 14-PRP*	CHF	4 965 000		4 965 000				
Total CHF							0,00	
EUR								
BHP BILLITON FINANCE LTD-REG-S-SUB 4.750%/VAR 15-22.04.76*	EUR	4 000 000	4 066 000		8 066 000	8 863 886	0,49	100 000
MERCK KGAA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 14-12.12.74*	EUR	6 000 000		6 000 000				
OMV AG-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP*	EUR	5 000 000		5 000 000				
SUEZ-REG-S-SUB 2.500%/VAR 15-PRP*	EUR	4 700 000			4 700 000	5 143 695	0,28	
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 15-PRP*	EUR		3 000 000		3 000 000	3 224 036	0,18	2 050 000
VOIVO TREASURY AB-REG-S-SUB 4.200%/VAR 14-10.06.75*	EUR	3 500 000		3 500 000				
Total EUR						17 231 617	0,94	
GBP								
AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.375%/VAR-REG-S-SUB 13-06.09.73*	GBP		5 029 000	5 029 000				
HSBC HOLDINGS PLC 2.175%/VAR 18-27.06.23*	GBP		4 100 000		4 100 000	4 945 240	0,27	
ORANGE SA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP*	GBP	3 000 000			3 000 000	3 740 731	0,20	
Total GBP						8 685 971	0,48	
USD								
DEMETER IBV FOR SR CO LTD-REG-S-SUB 4.625%/VAR 17-PRP*	USD		3 460 000		3 460 000	3 164 697	0,17	
MINOR INTERNATIONAL PCL-REG-S 3.100%/VAR 20-PRP*	USD		2 500 000		2 500 000	2 308 359	0,13	
Total USD						5 473 057	0,30	
Total Anleihen, variabler Zins						31 390 645	1,72	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 528 756 779	83,72	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
CAD								
ROGERS COMMUNICATIONS INC 4.70000% 10-29.09.20*	CAD	5 000 000		5 000 000				
Total CAD							0,00	
USD								
ABBOTT LABORATORIES 2.90000% 16-30.11.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
ABBVIE INC-144A 2.60000% 19-21.11.24*	USD		6 400 000		3 800 000	3 698 993	0,20	
APPLIED MATERIALS INC 2.625000% 15-01.10.20*	USD	5 000 000	500 000	5 500 000				
ARES CAPITAL CORP 3.250000% 20-15.07.25*	USD		7 900 000	7 900 000				
BARCLAYS PLC 2.875000% 15-08.06.20*	USD	5 000 000		5 000 000				
BLACKROCK INC/NEW YORK 4.250000% 11-24.05.21*	USD	5 552 000			5 552 000	5 232 431	0,29	
BNP PARIBAS 2.375000% 15-21.05.20*	USD	2 000 000		2 000 000				
BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 2.875000% 19-15.08.20*	USD		6 000 000	6 000 000				
BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 2.875000% 19-19.02.21*	USD		3 000 000	3 000 000				
BRISTOL MYERS SQUIBB CO 2.875000% 20-19.02.21*	USD		3 000 000		3 000 000	2 783 328	0,15	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 2.600000% 19-16.05.22*	USD	4 200 000	300 000	4 500 000				
BROADCOM INC 2.250000% 20-15.11.23*	USD		5 500 000		5 500 000	5 253 465	0,29	
BROADCOM INC-144A 3.125000% 19-15.10.22*	USD	4 200 000		4 200 000				
CARGILL INC-144A 1.375000% 20-23.07.23*	USD		3 000 000		3 000 000	2 819 341	0,15	
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 2.300000% 17-12.02.21*	USD	4 000 000		4 000 000		3 697 554	0,20	
DNB BANK ASA-144A 2.125000% 17-02.10.20*	USD	8 000 000		8 000 000				
EOG RESOURCES INC 4.100000% 10-01.02.21*	USD	7 000 000		7 000 000		6 511 931	0,36	
FISERV INC 2.700000% 15-01.06.20*	USD	4 800 000		4 800 000				
GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 5.400000% 10-01.11.20*	USD	2 000 000	400 000		2 400 000	2 213 669	0,12	
GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 2.539000% 14-15.11.19*	USD	8 825 000		8 825 000				
HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-144A 3.350000% 20-08.06.25*	USD		3 300 000	3 300 000				
HSBC FINANCE CORP-SUB 6.676000% 11-15.01.21*	USD	4 468 000		4 468 000	4 468 000	4 152 767	0,23	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV 6.000000% 12-15.11.21*	USD	6 500 000		6 500 000	6 500 000	6 245 928	0,34	
MACQUARIE GROUP LTD-144A 6.000000% 10-14.01.20*	USD	1 500 000		1 500 000				
MANUFACTURERS & TRADERS TRUST CO 2.625000% 18-25.01.21*	USD	4 000 000		4 000 000	4 000 000	3 694 441	0,20	
MERCK & CO INC 2.400000% 12-15.09.22*	USD	5 000 000		5 000 000	5 000 000	4 764 867	0,26	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 3.450000% 18-09.10.21*	USD	3 000 000		3 000 000				
MICROSOFT CORP 3.625000% 13-15.12.23*	USD		1 800 000		1 800 000	1 812 495	0,10	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.500000% 18-12.01.21*	USD	7 000 000		7 000 000				
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 3.700000% 18-04.11.21*	USD	3 750 000	300 000		4 050 000	3 850 761	0,21	
NESTLE HOLDINGS INC-144A 3.350000% 18-24.09.23*	USD	6 224 000		6 224 000	6 224 000	6 186 661	0,34	
NESTLE HOLDINGS INC-144A 0.375000% 20-15.01.24*	USD		21 300 000	9 700 000	11 600 000	10 615 400	0,58	
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.950000% 19-28.01.21*	USD	4 500 000		4 500 000				
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.875000% 19-10.04.24*	USD	8 000 000	7 500 000		15 500 000	15 296 745	0,84	
NEWCREST FINANCE PTY LTD-144A 4.450000% 11-15.11.21*	USD	4 000 000		4 000 000				
NEWMONT GOLDCORP CORP 3.500000% 12-15.03.22*	USD	3 000 000		3 000 000				
NUTRITION & BIOSCIENCES INC-144A 0.697000% 20-15.09.22*	USD		2 000 000		2 000 000	1 840 528	0,10	
NUTRITION & BIOSCIENCES INC-144A 1.230000% 20-01.10.25*	USD		4 700 000		4 700 000	4 307 309	0,24	
PERNOD RICARD SA-REG-S 4.250000% 12-15.07.22*	USD	2 000 000		2 000 000	2 000 000	1 954 710	0,11	
PROCTER & GAMBLE CO 2.450000% 20-25.03.25*	USD	5 000 000		5 000 000	5 000 000	4 975 073	0,27	
ROYALTY PHARMA PLC-144A 0.750000% 20-02.09.23*	USD	2 000 000		2 000 000	2 000 000	1 831 431	0,10	
SCHLUMBERGER FINANCE CANADA LTD-144A 2.200000% 17-20.11.20*	USD	6 600 000	1 400 000		8 000 000	7 369 105	0,40	
SCHLUMBERGER INVESTMENT SA-144A 2.400000% 12-01.08.22*	USD	3 500 000		3 500 000	3 500 000	3 299 937	0,18	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.900000% 15-27.05.22*	USD	3 000 000		3 000 000				

Titel		30.9.2019 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2020 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 1.70000% 16-15.09.21*	USD	4 000 000	3 000 000		7 000 000	6 518 258	0,36	
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.70000% 17-16.03.22*	USD	3 000 000			3 000 000	2 847 264	0,16	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 2.62500% 16-15.03.21*	USD	5 631 000			5 631 000	5 229 018	0,29	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 0.85000% 20-02.09.25*	USD		10 800 000		10 800 000	9 909 798	0,54	
SUMITOMO MITSUI BANKING 2.51400% 18-17.01.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
UJOHN INC-REG-S 1.65000% 20-22.06.25*	USD		1 100 000		1 100 000	1 034 518	0,06	
WALT DISNEY CO-144A 3.00000% 19-15.09.22*	USD	3 000 000		3 000 000				
WASTE MANAGEMENT INC 4.75000% 10-30.06.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC-144A 4.00000% 15-29.04.20*	USD	7 750 000		7 750 000				
Total USD						139 947 728	7,66	
Total Notes, fester Zins						139 947 728	7,66	
Notes, variabler Zins								
USD								
BMW FINANCE NV-144A 3M LIBOR+79BP 19-12.08.22*	USD	8 000 000			8 000 000	7 383 779	0,40	
BNP PARIBAS SA-REG-S 2.219%/VAR 20-09.06.26*	USD		4 800 000	4 800 000				
BNP PARIBAS-144A 2.819%/VAR 19-19.11.25*	USD		3 600 000		3 600 000	3 485 507	0,19	
CANADIAN IMPERIAL BK OF COM O/N SOFR+80BP 19-17.03.23*	USD		3 300 000		3 300 000	3 054 311	0,17	
MPLX LP 3M LIBOR+110BP 19-09.09.22*	USD	6 300 000			6 300 000	5 788 358	0,32	
NATIONAL AUSTRALIA BANK-REG-S 3M LIBOR+41BP 20-13.12.22*	USD		16 550 000	3 550 000	13 000 000	11 974 565	0,66	
Total USD						31 686 520	1,74	
Total Notes, variabler Zins						31 686 520	1,74	
Medium-Term Notes, fester Zins								
CAD								
BELL CANADA 3.00000% 15-03.10.22*	CAD	4 000 000	4 000 000		8 000 000	5 727 085	0,31	
BROOKFIELD INFRASTRUCTURE FIN ULC-REG-S 3.53800% 15-30.10.20*	CAD	10 000 000		10 000 000				
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 2.89000% 13-14.08.20*	CAD	10 000 000		10 000 000				
Total CAD						5 727 085	0,31	
USD								
BB&T CORP 2.45000% 14-15.01.20*	USD	3 000 000		3 000 000				
Total USD							0,00	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						5 727 085	0,31	
Medium-Term Notes, variabler Zins								
USD								
BPCE SA 3M LIBOR+88BP 17-31.05.22*	USD	10 000 000			10 000 000	9 291 938	0,51	
EMIRATES NBD PJSC-REG-S 3M LIBOR+172BP 16-12.10.20*	USD	2 800 000			2 800 000	2 568 480	0,14	
Total USD						11 860 418	0,65	
Total Medium-Term Notes, variabler Zins						11 860 418	0,65	
Anleihen, fester Zins								
CAD								
BANK OF AMERICA CORP 3.22800% 15-22.06.22*	CAD	10 000 000			10 000 000	7 166 835	0,39	
Total CAD						7 166 835	0,39	
USD								
AT&T INC 3.60000% 16-17.02.23*	USD		8 000 000	8 000 000				
PERNOD RICARD SA-144A 5.75000% 11-07.04.21*	USD	5 088 000		2 552 000	2 536 000	2 393 111	0,13	
Total USD						2 393 111	0,13	
Total Anleihen, fester Zins						9 559 946	0,52	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						198 781 698	10,89	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins								
USD								
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.87500% 20-15.08.20**	USD		6 000 000	6 000 000				
ROYALTY PHARMA PLC-144A 1.20000% 20-02.09.25**	USD		3 700 000		3 700 000	3 388 620	0,19	
UBS AG/LONDON-REG-S 1.75000% 20-21.04.22**	USD		6 500 000		6 500 000	6 080 275	0,32	
Total USD						9 468 896	0,51	
Total Notes, fester Zins						9 468 896	0,51	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						9 468 896	0,51	
Total Wertschriften						1 737 007 373	95,12	
(davon ausgeliehen)						161 561 613	8,85	
Bankguthaben auf Sicht						85 264 213	4,67	
Derivative Finanzinstrumente						-8 236 737	-0,45	
Sonstige Vermögenswerte						12 091 027	0,66	
Gesamtfondsvermögen						1 826 125 876	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-9 669 000		
Andere Verbindlichkeiten						-732 514		
Nettofondsvermögen						1 815 724 362		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2020	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 727 754 606	94,62
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	1 016 030	0,05
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
Total	1 728 770 636	94,67

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BOBL FUTURE 08.12.20*	-600	EUR	87 377 039	-6 465	0.00
			87 377 039	-6 465	0.00

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.20*	550	EUR	66 537 968	2 963	0.00
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20*	400	USD	46 316 484	90 438	0.00
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20*	1 000	USD	203 007 862	129 193	0.01
			315 862 314	222 594	0.01

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 315 862 314

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
USD	8 500 000	CHF	7 749 511	19.10.2020	-56 445	0.00
EUR	277 000 000	CHF	297 453 265	19.10.2020	-942 735	-0.05
GBP	40 000 000	CHF	47 939 884	19.10.2020	446 644	0.02
USD	497 000 000	CHF	452 567 206	19.10.2020	-3 851 618	-0.21
USD	267 000 000	CHF	243 073 596	19.10.2020	-2 125 249	-0.12
EUR	2 600 000	CHF	2 793 618	19.10.2020	-7 211	0.00
USD	3 500 000	CHF	3 175 578	19.10.2020	-38 639	0.00
USD	3 000 000	CHF	2 726 583	19.10.2020	-28 460	0.00
GBP	55 000 000	CHF	64 440 629	23.10.2020	-853 500	-0.05
CAD	29 400 000	CHF	20 241 018	23.10.2020	30 168	0.00
EUR	285 000 000	CHF	306 586 898	23.10.2020	-413 431	-0.02
USD	276 000 000	CHF	252 807 665	23.10.2020	-612 390	-0.03
					-8 452 866	-0.46

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BOBL FUTURE 06.12.19	EUR	550	150
EURO-BOBL FUTURE 06.03.20	EUR	880	880
EURO-BOBL FUTURE 08.06.20	EUR	810	810
EURO-BOBL FUTURE 08.09.20	EUR	770	770
EURO-BOBL FUTURE 08.12.20	EUR	0	600
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.19	USD	350	150
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	USD	1 200	1 200
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	700	700

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-SCHATZ FUTURE 06.12.19	EUR	150	550
EURO-SCHATZ FUTURE 06.03.20	EUR	550	550
EURO-SCHATZ FUTURE 08.06.20	EUR	550	550
EURO-SCHATZ FUTURE 08.09.20	EUR	550	550
EURO-SCHATZ FUTURE 08.12.20	EUR	550	0

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.19	USD	200	800
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	USD	1 000	1 000
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	1 000	1 000
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.20	USD	2 070	2 070
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.20	USD	1 000	1 000
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.20	USD	950	950
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20	USD	700	300
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.20	USD	1 000	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	13 932 800	USD	14 000 000	18.11.2019
GBP	5 200 000	CHF	6 393 440	20.11.2019
CHF	4 858 894	EUR	4 400 000	26.11.2019
USD	100 000 000	CHF	98 430 400	05.12.2019
USD	265 300 000	CHF	261 848 182	13.12.2019
GBP	57 500 000	CHF	73 660 559	13.12.2019
USD	220 000 000	CHF	217 692 860	13.12.2019
USD	207 000 000	CHF	203 079 834	10.01.2020
EUR	241 500 000	CHF	262 432 979	10.01.2020
CAD	40 200 000	CHF	29 845 324	10.01.2020
USD	300 000 000	CHF	296 076 000	10.01.2020
EUR	194 000 000	CHF	213 024 804	10.01.2020
EUR	3 600 000	CHF	3 934 886	10.01.2020
GBP	8 050 000	CHF	10 306 230	10.01.2020
USD	72 000 000	CHF	70 786 728	10.01.2020
USD	472 200 000	CHF	463 974 748	15.01.2020
GBP	57 500 000	CHF	74 518 218	15.01.2020
USD	460 000 000	CHF	445 398 818	18.02.2020
EUR	20 000 000	CHF	21 671 500	09.03.2020
CAD	39 200 000	CHF	29 113 174	09.03.2020
GBP	8 300 000	CHF	10 546 378	09.03.2020
USD	595 000 000	CHF	574 829 024	09.03.2020
EUR	463 477 938	CHF	500 000 000	09.03.2020
GBP	66 500 000	CHF	83 584 761	09.03.2020
GBP	700 000	CHF	878 175	09.03.2020
USD	1 800 000	CHF	1 737 049	09.03.2020
EUR	7 000 000	CHF	7 512 652	09.03.2020
EUR	8 000 000	CHF	8 563 720	09.03.2020
EUR	6 000 000	CHF	6 429 750	09.03.2020
EUR	2 700 000	CHF	2 894 152	09.03.2020
GBP	4 800 000	CHF	6 077 026	09.03.2020
EUR	3 500 000	CHF	3 740 664	09.03.2020
GBP	7 100 000	CHF	8 949 905	09.03.2020
GBP	87 500 000	CHF	107 380 595	23.03.2020
EUR	505 000 000	CHF	537 261 925	23.03.2020
USD	580 000 000	CHF	551 266 220	23.03.2020
CAD	39 300 000	CHF	27 856 685	23.03.2020
CHF	1 059 876	EUR	1 000 000	23.03.2020
GBP	2 000 000	CHF	2 419 004	23.03.2020
EUR	15 000 000	CHF	15 895 505	23.03.2020
CHF	1 059 805	EUR	1 000 000	23.03.2020
CHF	605 907	GBP	500 000	23.03.2020
CHF	2 113 736	EUR	2 000 000	23.03.2020
CHF	237 523	GBP	200 000	23.03.2020
CHF	2 859 363	USD	3 000 000	23.03.2020
CHF	3 785 344	USD	4 000 000	23.03.2020
CHF	4 227 637	EUR	4 000 000	23.03.2020
CHF	579 020	GBP	500 000	23.03.2020
CHF	1 162 852	GBP	1 000 000	23.03.2020
CHF	57 193 720	GBP	50 000 000	23.03.2020
CHF	210 783 960	EUR	200 000 000	23.03.2020
CHF	291 223 680	USD	300 000 000	23.03.2020
CHF	13 376 060	CAD	20 000 000	23.03.2020
USD	435 000 000	CHF	424 734 087	17.04.2020
USD	16 000 000	CHF	15 558 856	17.04.2020
GBP	37 000 000	CHF	42 012 601	24.04.2020
CAD	19 300 000	CHF	12 972 657	24.04.2020
EUR	298 000 000	CHF	313 783 570	24.04.2020
USD	268 000 000	CHF	260 613 920	24.04.2020
CHF	9 860 473	USD	10 000 000	24.04.2020
CHF	3 162 051	EUR	3 000 000	24.04.2020
CHF	1 059 453	EUR	1 000 000	24.04.2020
CHF	4 899 889	USD	5 000 000	24.04.2020
EUR	10 000 000	CHF	10 626 140	24.04.2020
EUR	196 000 000	CHF	206 406 875	04.05.2020
GBP	48 000 000	CHF	54 811 450	04.05.2020
USD	298 000 000	CHF	288 396 324	04.05.2020
CAD	19 000 000	CHF	12 672 789	04.05.2020
CHF	281 996 000	USD	290 000 000	04.05.2020
CHF	13 262 190	CAD	19 000 000	04.05.2020
CHF	58 067 520	GBP	48 000 000	04.05.2020
GBP	36 000 000	CHF	42 988 896	22.05.2020
USD	253 000 000	CHF	245 026 705	22.05.2020
CAD	19 700 000	CHF	13 497 303	22.05.2020
EUR	310 000 000	CHF	326 027 620	22.05.2020
GBP	49 000 000	CHF	59 252 544	22.05.2020
CAD	19 400 000	CHF	13 535 611	22.05.2020
EUR	193 000 000	CHF	203 836 178	22.05.2020
USD	294 000 000	CHF	285 746 450	22.05.2020
CHF	47 596 000	GBP	40 000 000	22.05.2020
CHF	27 269 580	CAD	39 000 000	22.05.2020
CHF	270 804 900	EUR	255 000 000	22.05.2020
CHF	265 470 000	EUR	250 000 000	22.05.2020
CHF	53 539 650	GBP	45 000 000	22.05.2020
CHF	262 275 300	USD	270 000 000	22.05.2020

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	262 286 100	USD	270 000 000	22.05.2020
USD	1 800 000	CHF	1 742 892	19.06.2020
USD	475 000 000	CHF	458 222 525	19.06.2020
USD	7 200 000	CHF	6 986 369	19.06.2020
EUR	255 000 000	CHF	270 675 870	17.07.2020
GBP	40 000 000	CHF	47 531 720	17.07.2020
USD	274 000 000	CHF	265 733 968	17.07.2020
EUR	5 400 000	CHF	5 770 440	17.07.2020
EUR	6 000 000	CHF	6 418 104	17.07.2020
USD	203 000 000	CHF	192 833 516	17.07.2020
EUR	7 000 000	CHF	7 439 914	17.07.2020
CAD	39 000 000	CHF	27 224 769	24.07.2020
EUR	250 000 000	CHF	265 327 200	24.07.2020
GBP	45 000 000	CHF	53 457 660	24.07.2020
USD	270 000 000	CHF	261 812 520	24.07.2020
USD	10 000 000	CHF	9 633 450	24.07.2020
EUR	1 000 000	CHF	1 080 693	24.07.2020
USD	3 000 000	CHF	2 844 453	24.07.2020
GBP	1 000 000	CHF	1 188 841	24.07.2020
EUR	3 000 000	CHF	3 202 251	24.07.2020
USD	280 000 000	CHF	265 944 840	24.07.2020
EUR	7 000 000	CHF	7 464 996	24.07.2020
USD	10 100 000	CHF	9 586 612	24.07.2020
GBP	7 300 000	CHF	8 619 528	24.07.2020
GBP	7 000 000	CHF	8 260 245	24.07.2020
EUR	8 200 000	CHF	8 749 949	24.07.2020
CHF	20 000 000	USD	21 118 562	24.07.2020
EUR	3 000 000	CHF	3 185 397	24.07.2020
EUR	280 000 000	CHF	301 632 324	28.08.2020
USD	477 000 000	CHF	449 734 108	28.08.2020
GBP	40 000 000	CHF	47 512 428	28.08.2020
USD	263 000 000	CHF	244 342 228	08.09.2020
CAD	39 300 000	CHF	27 160 662	23.09.2020
EUR	284 000 000	CHF	306 265 600	23.09.2020
GBP	60 500 000	CHF	71 415 350	23.09.2020
USD	272 000 000	CHF	252 589 808	23.09.2020
EUR	50	CHF	54	28.09.2020
USD	8 500 000	CHF	7 749 511	19.10.2020
EUR	277 000 000	CHF	297 453 265	19.10.2020
GBP	40 000 000	CHF	47 939 884	19.10.2020
USD	497 000 000	CHF	452 567 206	19.10.2020
USD	267 000 000	CHF	243 073 596	19.10.2020
EUR	2 600 000	CHF	2 793 618	19.10.2020
USD	3 500 000	CHF	3 175 578	19.10.2020
USD	3 000 000	CHF	2 726 583	19.10.2020
GBP	55 000 000	CHF	64 440 629	23.10.2020
CAD	29 400 000	CHF	20 241 018	23.10.2020
EUR	285 000 000	CHF	306 586 898	23.10.2020
USD	276 000 000	CHF	252 807 665	23.10.2020

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	315 862 313,80	17,40%
Total engagement- reduzierende Positionen	1 798 001 611,85	99,02%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung der Teilvermögen
keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,1425% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,3725% p.a.;
 - Klasse I-A2 Cap: 0,3725% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,35% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,65% p.a.;
 - Klasse I-A2 Cap: 0,65% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,20% p.a.

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich
«soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Be-
rechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER)
von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management
Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen
Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen
Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsver-
mögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv
in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,15%
Klasse I-A2:	0,38%
Klasse I-A2 Cap:	0,38%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF 0.687816	GBP 1 = CHF 1.187760
EUR 1 = CHF 1.077372	USD 1 = CHF 0.918750

Anhang zu Ergänzende Angaben

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Grundsätze der Bewertung

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Bewertungstag eines Teilvermögens («Bewertungstag») ist jeweils der auf einen Ausgabe- und Rücknahmetag gemäss § 19 Ziff. 1 unten (in Verbindung mit den massgeblichen Bestimmungen des Besonderen Teils) folgende Bankarbeitstag in Zürich. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Bewertung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit der neuen Verhältnissen angepasst.
6. Derivative Finanzinstrumente, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Derivative Finanzinstrumente, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden (OTC - Derivate), sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens, abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern
 - (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen.
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen.

- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Klasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Grundsätze der Nettoinventarwertberechnung

Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens eines Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 1/100 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Klasse gerundet. Der Besondere Teil kann für einzelne Rechnungseinheiten bzw. Referenzwährungen abweichende Rundungsbestimmungen vorsehen.

(OTC-)Derivate und Effektenleihe

Führt das Teilvermögen ausserbörsliche Transaktionen (OTC-Geschäfte) durch, so kann es dadurch Risiken im Zusammenhang mit der Kreditwürdigkeit der OTC-Gegenpartei ausgesetzt sein: bei Abschluss von Terminkontrakten, Optionen und Swap-Transaktionen oder Verwendung sonstiger derivativer Techniken unterliegt das Teilvermögen dem Risiko, dass eine OTC-Gegenpartei ihren Verpflichtungen aus einem bestimmten oder mehreren Verträgen nicht nachkommt (bzw. nicht nachkommen kann). Das Kontrahentenrisiko kann durch die Hinterlegung einer Sicherheit verringert werden. Falls dem Teilvermögen ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für das Teilvermögen verwahrt. Konkurs- und Insolvenzfälle bzw. sonstige Kreditausfallereignisse bei der OTC-Gegenpartei, der Depotbank oder innerhalb ihres Unterverwahrstellen-/ Korrespondenzbanknetzwerks können dazu führen, dass die Rechte oder die Anerkennung des Teilvermögens in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was das Teilvermögen zwingen würde, seinen Verpflichtungen im Rahmen der OTC-Transaktion nachzukommen, und zwar trotz eines Wertpapiers, das zuvor zur Verfügung gestellt wurde, um eine solche Verpflichtung abzusichern.

Die Gesellschaft darf ebenfalls Teile ihres Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im Allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

Gegenparteien, Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten aus OTC-Derivaten:

Stichtag: 30.9.2020	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)
Währung:	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate					
Basler Kantonalbank	-282 509.45	-	-	-813 427.14	-
Credit Agricole Corp	-	5 036 419.00	-933 384.89	-	-3 851 618.11
Goldman Sachs	-	242 395.10	295 174.52	-	-1 796 235.44
JP Morgan	-	354 920.81	239 960.15	-	-681 471.32
UBS AG	-	144 617.61	-882 376.77	-118 133.51	1 707.55
Zuercher Kantonalbank	-294 456.16	-2 331 457.01	1 339 143.36	-1 333 400.43	-2 125 249.14
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:					
- Anleihen	-	-	-	-	-
- Aktien	-	-	-	-	-
- Barmittel	-	-	-	-	-
- Anlagefonds	-	-	-	-	-
- Geldmarktanlagen	-	-	-	-	-
- Übrige Sicherheiten	-	-	-	-	-
Total entgegengenommenen Sicherheiten	-	-	-	-	-

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum: 1. Oktober 2019 - 30. September 2020	Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. September 2020					
UBS AG					
- Marktwert der verliehenen Effekten	23 209 905.30 CHF	64 484 582.63 CHF	34 365 762.30 CHF	100 733 467.98 CHF	196 790 337.46 CHF
- Sicherheiten	24 380 362.40 CHF	67 758 695.95 CHF	36 104 045.38 CHF	105 869 954.02 CHF	206 829 612.37 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. September 2020					
nach Art der Vermögenswerte:					
- Anleihen	95.77	98.86	59.70	45.83	75.17
- Aktien	4.23	1.14	40.30	54.17	24.83
- Geldmarktanlagen	-	-	-	-	-
Effektenleihe					
Erträge aus der Effektenleihe	73 779.27 CHF	107 713.26 CHF	68 170.00 CHF	153 436.07 CHF	274 091.21 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	22 133.78 CHF	32 313.98 CHF	20 451.00 CHF	46 030.82 CHF	82 227.36 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	51 645.49 CHF	75 399.28 CHF	47 719.00 CHF	107 405.25 CHF	191 863.85 CHF

Berichtszeitraum: 1. Oktober 2019 - 30. September 2020	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. September 2020			
UBS AG			
- Marktwert der verliehenen Effekten	35 821 189.49 CHF	18 645 191.90 CHF	154 447 839.34 CHF
- Sicherheiten	37 632 164.25 CHF	19 677 417.42 CHF	162 269 919.81 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. September 2020			
nach Art der Vermögenswerte:			
- Anleihen	100.00	92.23	74.18
- Aktien	0.00	7.77	25.82
- Geldmarktanlagen	-	-	-
Effektenleihe			
Erträge aus der Effektenleihe	88 548.86 CHF	28 710.50 CHF	221 280.31 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	26 564.66 CHF	8 613.15 CHF	66 384.09 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	61 984.20 CHF	20 097.35 CHF	154 896.22 CHF

Der Marktwert der verliehenen Effekten sowie die Werte der erhaltenen Sicherheiten für ausgeliehene Wertschriften in der Tabelle Effektenleihe und Sicherheiten beziehen sich auf die Daten der Depotbank per Monatsultimo.

Die Ausgleichszahlungen und die Kommissionserträge aus Effektenleihe in den Erfolgsrechnungen sowie die im Inventar ausgewiesenen, ausgeliehenen Werte stammen hingegen aus der Wertschriftenbuchhaltung. Die Wertschriftenbuchhaltung verbucht die ausgeliehenen Wertschriften an T+1 gegenüber der Depotbank.